

Italy-Rome: Financial consultancy services**OJ S 91/2021 11/05/2021****Contract award notice****Services****Legal Basis:**

Directive 2014/24/EU

Section I: Contracting authority

I.1. Name and addresses

Official name: Ente nazionale di previdenza ed assistenza dei medici e degli odontoiatri (fondazione ENPAM) Pers. giurid. di diritto privato ai sensi del D.Lgs. 509/94

Postal address: p.zza Vittorio Emanuele II 78

Town: Roma

NUTS code: ITI43 Roma

Postal code: 00185

Country: Italy

Contact person: Domenico D'Amico

E-mail: appalti@pec.enpam.it

Telephone: +39 0648294393

Fax: +39 0648294502

Internet address(es):

Main address: www.enpam.it

Address of the buyer profile: <https://appalti.enpam.it>

I.4. Type of the contracting authority

Other type: fondazione

I.5. Main activity

Other activity: previdenza e assistenza

Section II: Object

II.1. Scope of the procurement**II.1.1. Title**

Procedura aperta telematica per l'affidamento dei servizi di Risk Analysis ed Advisory di supporto agli organi di Fondazione Enpam nelle analisi e nelle valutazioni dei rischi del portafoglio di investimento

Reference number: 854129646F

II.1.2. Main CPV code

66171000 Financial consultancy services

II.1.3. Type of contract

Services

II.1.4. Short description

Costituisce oggetto dell'appalto l'affidamento dei servizi di «Risk Analysis ed Advisory di supporto agli organi di fondazione Enpam nelle analisi e nelle valutazioni dei rischi del portafoglio di investimento».

Le prestazioni sono meglio specificate nel capitolato tecnico prestazionale e dovranno essere rese dall'appaltatore secondo le modalità indicate nello stesso.

II.1.6. Information about lots

This contract is divided into lots: no

II.1.7. Total value of the procurement

Value excluding VAT: 390 000,00 EUR

II.2. Description

II.2.3. Place of performance

NUTS code: ITI43 Roma

Main site or place of performance: Roma.

II.2.4. Description of the procurement

Sono oggetto dell'appalto le seguenti attività:

I) analisi dell'efficacia della struttura di patrimonio in ottica di bilanciamento delle passività (Asset Liability Management — ALM) secondo l'approccio Liability Driven Investment, articolato su due portafogli distinti per obiettivi, funzioni e contributo:

1) Portafoglio di copertura delle passività (PCP), che avrà l'obiettivo di garantire la puntuale solvibilità delle prestazioni, assorbendo prevalentemente rischio controparte e

2) Portafoglio a performance (PP), che avrà l'obiettivo di garantire la sostenibilità dello schema, assorbendo prevalentemente rischio di mercato; a latere, è sempre prevista una riserva di liquidità. Assunto il limite di rischio generale dato dalla propensione al rischio della fondazione, che i due portafogli congiuntamente contribuiranno a saturare, per il PCP verranno implementati investimenti idonei alla copertura diretta delle prestazioni, facenti parte di determinate categorie, con rischio idiosincratico, mentre per il PP verranno implementati investimenti secondo uno schema di Asset Allocation strategica (AAS) e tattica (AAT), la cui struttura andrà analizzata e condivisa, cui sarà associato un budget di rischio (RAS), anch'esso da analizzare e condividere. Tenuto conto degli obiettivi generali di redditività di lungo periodo, e della graduale crescita del PCP che esprimerà un rendimento tecnico, la gestione del patrimonio vedrà un processo dinamico di allocazione della liquidità e riallocazione tra i due portafogli che condizionerà nel tempo composizione e redditività del PP, tenuto conto del limite di rischio generale;

II) analisi, valutazione e contribuzione dei rendimenti e stima dell'efficacia delle coperture;

III) analisi, misurazione e contribuzione del rischio – complessiva e disgiunta per portafoglio;

IV) misurazione ed analisi dei rischi ambientali, sociali e di governo societario (ESG) – complessiva e disgiunta per portafoglio;

V) supporto alla struttura nelle analisi e valutazioni relative al processo di ALM;

VI) supporto al consiglio di amministrazione, e all'UVIP Unità valutazione investimenti patrimoniali, nelle analisi e nelle valutazioni dei rischi di patrimonio, e dei due portafogli;

VII) attività di formazione del personale della fondazione su procedure, metodologie di calcolo e di valutazione e sistemi, anche informatici, utilizzati dall'advisor nello svolgimento dei servizi oggetto dell'appalto.

Le prestazioni sono meglio specificate nel capitolato tecnico prestazionale e dovranno essere rese dall'appaltatore secondo le modalità indicate nello stesso.

II.2.5. Award criteria

Quality criterion - Name: Offerta tecnica / Weighting: 75

Price - Weighting: 25

II.2.11. Information about options

Options: yes

Description of options:

La fondazione si riserva la facoltà di rinnovare il contratto di anno in anno, alle medesime condizioni, per una durata massima pari a 24 (ventiquattro) mesi, per un importo massimo di 434 000,00 EUR (quattrocentotrentaquattomila/00) oltre oneri di legge.

Per quanto sopra esposto ed ai fini della determinazione delle soglie di cui all'art. 35, comma 4 del codice e ss.mm.ii., il valore massimo stimato dell'appalto, è pari a 1 084 000,00 EUR oltre oneri di legge. Non sono previsti oneri per la sicurezza da rischi da interferenze.

Nota bene: la fondazione eserciterà tale facoltà comunicandola all'appaltatore mediante posta elettronica certificata (PEC) almeno 60 giorni prima della scadenza del contratto originario (successivamente, almeno 60 giorni prima di ogni ulteriore scadenza annuale).

II.2.13. Information about European Union funds

The procurement is related to a project and/or programme financed by European Union funds:
no

II.2.14. Additional information

Section IV: Procedure

IV.1. Description

IV.1.1. Type of procedure

Open procedure

IV.1.3. Information about a framework agreement or a dynamic purchasing system

IV.1.8. Information about the Government Procurement Agreement (GPA)

The procurement is covered by the Government Procurement Agreement: yes

IV.2. Administrative information

IV.2.1. Previous publication concerning this procedure

Notice number in the OJ S: [2020/S 239-590931](#)

IV.2.8. Information about termination of dynamic purchasing system

IV.2.9. Information about termination of call for competition in the form of a prior information notice

Section V: Award of contract

Contract No: 854129646F

Lot No: 1

Title:

Procedura aperta telematica per l'affidamento dei servizi di Risk Analysis ed Advisory di supporto agli organi di Fondazione Enpam nelle analisi e nelle valutazioni dei rischi del portafoglio di investimento.

A contract/lot is awarded: yes

V.2. Award of contract

V.2.1. Date of conclusion of the contract

16/04/2021

V.2.2. Information about tenders

Number of tenders received: 2

Number of tenders received from SMEs: 2

Number of tenders received by electronic means: 2

The contract has been awarded to a group of economic operators: no

V.2.3. Name and address of the contractor

Official name: Prometeia advisor sim SpA

Postal address: piazza Trento e Trieste

Town: Bologna

NUTS code: ITI43 Roma

Postal code: 40137

Country: Italy

E-mail: prometeiaadvisorsim@postecert.it

Telephone: +39 0516480911

Fax: +39 051220753

Internet address: <https://www.prometeia.it/financial-advisory>

The contractor is an SME: yes

V.2.4. Information on value of the contract/lot

Initial estimated total value of the contract/lot: 650 000,00 EUR

Total value of the contract/lot: 390 000,00 EUR

V.2.5. Information about subcontracting

Section VI: Complementary information

VI.3. Additional information

VI.4. Procedures for review

VI.4.1. Review body

Official name: Tribunale amministrativo regionale — Sezione Roma

Postal address: via Flaminia 189

Town: Roma

Postal code: 00196

Country: Italy

Telephone: +39 06328721

VI.4.2. Body responsible for mediation procedures

Official name: Affari legali della fondazione ENPAM

Postal address: piazza Vittorio Emanuele 78

Town: Roma

Postal code: 00185

Country: Italy

Telephone: +39 0648294305

VI.4.4. Service from which information about the review procedure may be obtained

Official name: Affari legali della fondazione ENPAM

Postal address: piazza Vittorio Emanuele 78

Town: Roma

Postal code: 00185

Country: Italy

Telephone: +39 0648294305

VI.5. Date of dispatch of this notice

06/05/2021