

Italy-Rome: Financial consultancy services

OJ S 239/2020 08/12/2020

Contract 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.3. Communication

The procurement documents are available for unrestricted and full direct access, free of charge, at: <https://appalti.enpam.it>

Additional information can be obtained from the abovementioned address

Tenders or requests to participate must be submitted electronically via: <https://appalti.enpam.it>

Tenders or requests to participate must be submitted to the abovementioned address

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 inv.»

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.1.5. Estimated total value

Value excluding VAT: 1 084 000,00 EUR

II.1.6. Information about lots

This contract is divided into lots: no

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:

1) 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:

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

b) 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 idiosincratco, 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 condiziona nel tempo composizione e redditività del PP, tenuto conto del limite di rischio generale;

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

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

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

5) supporto alla struttura nelle analisi e valutazioni relative al processo di alm;

6) 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;

7) 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

Price is not the only award criterion and all criteria are stated only in the procurement documents

II.2.6. Estimated value

Value excluding VAT: 650 000,00 EUR

II.2.7. Duration of the contract, framework agreement or dynamic purchasing system

Duration in months: 36

This contract is subject to renewal: yes

Description of renewals:

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.

II.2.10. Information about variants

Variants will be accepted: no

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 III: Legal, economic, financial and technical information

III.1. Conditions for participation

III.1.1. Suitability to pursue the professional activity, including requirements relating to enrolment on professional or trade registers

List and brief description of conditions:

Possesso dell'autorizzazione a svolgere servizi di consulenza in materia d'investimenti ai sensi dell'art. 1, comma 5, lett. f) D.Lgs 58/1998 o abilitazione a svolgere in Italia i medesimi servizi ex artt. 27, 28 e 29 del D.Lgs. 58/1998 e che non abbiano subito provvedimenti ingiuntivi dell'autorità di vigilanza ai sensi del titolo IV capo I D.Lgs. 58/1998;
Per gli operatori economici con sede in Stati che non siano membri dell'Unione europea, autorizzazione dell'esercizio dell'attività di consulenza in materia d'investimenti conforme alle normative vigenti nel Paese di appartenenza.

III.1.2. Economic and financial standing

Selection criteria as stated in the procurement documents

III.1.3. Technical and professional ability

Selection criteria as stated in the procurement documents

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.2.2. Time limit for receipt of tenders or requests to participate

Date: 18/01/2021 Local time: 12:00

IV.2.3. Estimated date of dispatch of invitations to tender or to participate to selected candidates

IV.2.4. Languages in which tenders or requests to participate may be submitted

Italian

IV.2.6. Minimum time frame during which the tenderer must maintain the tender

Duration in months: 6 (from the date stated for receipt of tender)

IV.2.7. Conditions for opening of tenders

Date: 25/01/2021 Local time: 10:00

Place:

la data della prima seduta pubblica è puramente indicativa; la data effettiva di apertura delle offerte sarà comunicata, agli operatori economici che parteciperanno alla procedura, mediante avviso sul portale: <https://appalti.enpam.it>

Information about authorised persons and opening procedure: In considerazione dell'attuale situazione di emergenza sanitaria le sedute di gara verranno effettuate in videoconferenza.

Alle sedute potranno partecipare i legali rappresentanti/procuratori delle imprese interessate oppure persone munite di specifica delega. In assenza di tali titoli, la partecipazione è ammessa come semplice uditore.

Section VI: Complementary information

VI.1. Information about recurrence

This is a recurrent procurement: no

VI.2. Information about electronic workflows

Electronic invoicing will be accepted

Electronic payment will be used

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

03/12/2020