



Fondo Pensione MONTE DEI PASCHI DI SIENA

Invito a proporre investimenti in FIA chiusi al Fondo Pensione MPS
[02/11/2023]

- 1) Il Consiglio di Amministrazione (C.d.A.) del Fondo Pensione MPS, o anche “FP”, nel corso della riunione del 27/10/2023, nel rispetto delle rispettive indicazioni statutarie, in analogia con le previsioni dell’art. 6, c. 6, D.Lgs. 252/2005 e la Deliberazione COVIP 9/12/1999, ha deliberato di dar corso alla selezione di FIA chiusi per la successiva sottoscrizione di quote, secondo principi di sicurezza e prudenza, nel rispetto e a tutela degli associati, al fine di conseguire un’adeguata copertura pensionistica complementare.
- 2) Il FP intende selezionare e sottoscrivere per un ammontare complessivo stimabile in EUR 25 milioni, non vincolante, FIA con le seguenti caratteristiche:

FIA chiuso – PRIVATE DEBT Italia

Caratteristiche:

Tipologia di gestione: il FIA investe in “Private Debt”. Il FIA può adottare strategie focalizzate su senior secured loans con sub/mezzanine come allocazione residuale (max 30%).

Requisiti di partecipazione (vincolanti):

Esclusioni: debito per infrastrutture (infrastructure debt) e debito immobiliare compresi i CMO; la quota investibile in NPL NON può eccedere il 20% del valore del patrimonio; la quota investibile in distressed debt NON può eccedere il 30% del valore del patrimonio.

Focus geografico: le imprese emittenti, per almeno il 70%, devono essere domiciliate in Italia.

- FIA italiano o FIA UE, rientranti nell’ambito di applicazione della direttiva 2011/61/UE, di tipo chiuso;
- Collocamento/sottoscrizione delle quote del FIA: primario;
- Valuta di denominazione delle quote: Euro;
- Obiettivo di raccolta del FIA (da regolamento) minimo EUR 100 milioni;
- Il GEFIA deve avere in gestione FIA chiusi con attivi pari ad almeno EUR 300 milioni;



FONDO PENSIONE MONTE DEI PASCHI DI SIENA

- Durata del FIA, da Regolamento, non oltre 12 anni incluse estensioni o proroghe non approvate dall'Assemblea dei sottoscrittori;
 - Il FIA deve essere classificato ai sensi dell'Art. 8 o 9 della direttiva SFDR;
 - Almeno il 70% degli strumenti in portafoglio devono essere denominati in Euro;
 - Alla sottoscrizione il FIA deve dimostrare impegni di investimento già sottoscritti (hard commitment) da altri investitori per almeno EUR 50 milioni.
- 3) Possono presentare le offerte i soggetti di cui all'articolo 6, comma 1, del D.Lgs.252/05 che alla data di pubblicazione della presente comunicazioni siano in possesso dei seguenti requisiti:
- La Società proponente - GEFIA - deve essere: i) titolare dell'autorizzazione di cui all'articolo 34 del TUF e deve essere iscritta all'Albo di cui all'art. 35 del TUF o ii) autorizzata ai sensi della direttiva 2011961/UE in uno stato diverso dall'Italia ed esercitare la gestione di uno o più FIA;
 - Quelli fissati dalle rispettive autorità di vigilanza ai sensi dell'art.6, comma 7, del D. Lgs.252/05;
 - La sede statutaria del GEFIA deve essere in uno dei Paesi aderenti all'Unione Europea.

La mancanza di uno o più requisiti costituisce non conformità della candidatura e l'esclusione dalla procedura di selezione.

- 4) L'Offerta, per ciascun FIA, è costituita dai seguenti documenti:
- a. Regolamento/prospetto del FIA;
 - b. Documento di collocamento (PPM o offering memorandum);
 - c. Due Diligence Questionnaire precompilato (preferibilmente nello standard ILPA o INREV);
 - d. MangustaRisk Ltd. – DDQ_PD.xlsx;
 - e. MangustaRisk Ltd. – SDDQ_FIA_PD.docx;
 - f. La presentazione del FIA (preferibilmente conforme agli Invest Europe Professional Standard).

La documentazione dovrà pervenire entro e non oltre le ore **12:00 (CET) del 24 novembre 2023** all'indirizzo di posta elettronica fondopensionemps@postacert.gruppo.mps.it; l'oggetto della mail dovrà contenere, oltre al nome identificativo della Società offerente, anche la dicitura "SELEZIONE FIA CHIUSI PRIVATE DEBT".

Eventuali quesiti riferiti alla compilazione dei Questionari devono essere inoltrati esclusivamente al Fondo in forma scritta via e-mail al seguente indirizzo selezioneFIA@fondopensionemps.it entro e non oltre le ore **12.00 del 17 novembre 2023**.



FONDO PENSIONE
MONTE DEI PASCHI DI SIENA

- 5) Tenendo conto di quanto previsto dalle delibere preliminari assunte dal C.d.A., si procederà alla valutazione delle Offerte, con particolare attenzione al modello di gestione ed al sistema di valutazione dei fattori ESG nel portafoglio del FIA, a seguito delle quali saranno identificate le candidature ritenute di maggior interesse per il FP, che faranno parte della short list. Il numero di tali candidati sarà tale da consentire il raffronto tra una pluralità di soggetti, tenendo in debita considerazione l'appartenenza a gruppi societari ed i rapporti di controllo.
- 6) Il FP si riserva di richiedere ai gestori dei FIA eventuali integrazioni della documentazione trasmessa, mediante: un questionario specifico predisposto ed inviato dal FP, la partecipazione ad una audizione oltre alla disponibilità di eseguire l'attività di due diligence on-site.
- 7) La valutazione delle condizioni economiche di cui al Regolamento completerà quella ottenuta con la valutazione tecnica.
- 8) Il mancato rispetto di uno o più dei termini, delle modalità e delle condizioni di partecipazione alla selezione sopra indicati, nonché di una o più delle prescrizioni redazionali contenute nel questionario costituirà elemento di valutazione, da parte del Consiglio di Amministrazione, anche ai fini dell'esclusione del candidato dalla selezione.
- 9) A insindacabile giudizio del C.d.A. saranno quindi individuati i FIA e l'ammontare della sottoscrizione, previa specifica delibera entro un termine massimo di 90 giorni dal termine di presentazione dell'Offerta. Il procedimento di selezione si riterrà concluso, tramite apposita delibera del Consiglio di Amministrazione, unicamente dopo la definitiva approvazione del regolamento del FIA e dei contratti.
- 10) Il presente annuncio costituisce invito ad offrire e non offerta al pubblico ex art. 1336 c.c.. Il presente annuncio e la ricezione dell'eventuale offerta non comportano per il FP alcun obbligo o impegno a sottoscrivere nei confronti degli eventuali offerenti e, per loro, alcun diritto a qualsiasi titolo. Parimenti, nessun rimborso spese sarà dovuto per la documentazione prodotta e per gli eventuali incontri.
- 11) I dati personali inclusi nell'offerta saranno trattati in conformità alle disposizioni del GDPR 679/2016. In particolare, tali dati saranno trattati esclusivamente ai fini della partecipazione alla selezione delle offerte di cui al presente avviso e non verranno né comunicati né diffusi. Il Titolare del trattamento è il Fondo, nei confronti del quale l'interessato potrà far valere i diritti previsti dal citato GDPR 679/2016.

Siena, 2 novembre 2023