



Procedura aperta ai sensi del D.Lgs. n. 163/2006 per l'affidamento dei servizi di calcolo degli indicatori del rischio di mercato (CIG 58755121E3).

CHIARIMENTI (II)

2) E' stato richiesto se il software oggetto della fornitura/servizio deve essere in lingua italiana o può essere in inglese.

RISPOSTA

Può essere in inglese.

3) È stato richiesto se la connessione agli Information Provider (in termini di licenze e relativi costi) per l'acquisizione delle serie storiche (REQ 3.2.2.9) sarà fornita dalla Banca o è intesa a carico dell'aggiudicatario.

RISPOSTA

È interamente a carico dell'aggiudicatario.

4) È stato richiesto se la scelta del/degli Information Provider è in carico alla Banca o all'aggiudicatario.

RISPOSTA

È a carico dell'aggiudicatario, ma gli Information Provider devono essere di elevata qualità e di chiara fama sul mercato.

5) È stato richiesto se i servizi di supporto operativi (Helpdesk) possono essere forniti in lingua italiana o possono essere in inglese.

RISPOSTA

Possono essere in inglese.

6) È stato richiesto quali siano le fasi progettuali previste e le relative tempistiche di attivazione. In particolare, è stato richiesto se si prevede una fase preliminare di raccolta dei requisiti funzionali di dettaglio e di conseguente customizzazione del software.

RISPOSTA

I requisiti funzionali sono quelli evidenziati nel capitolato tecnico della gara; la Banca non parteciperà ad alcuna ulteriore attività di raccolta di requisiti dettagliati, né a collaudi tecnici derivanti da eventuali necessarie customizzazioni del software fornito dall'aggiudicatario.

7) È stato richiesto entro quanto tempo dall'aggiudicazione della gara il software deve essere pronto per il collaudo e il successivo rilascio in esercizio.

RISPOSTA

Il software dovrà essere reso disponibile per l'utilizzo effettivo a partire dal primo gennaio 2016; i collaudi dell'utente potranno quindi essere effettuati nel lasso di tempo intercorrente tra la data di aggiudicazione della gara e il momento della partenza in esercizio.

8) È stato richiesto se i livelli di servizio riportati nel "Capitolato Tecnico" siano da considerarsi definitivi o siano da declinare ulteriormente in seguito all'aggiudicazione.

RISPOSTA

I livelli di servizio sono da considerarsi definitivi

9) È stato richiesto, con riferimento all'esigenza di fruire del "servizio per il calcolo degli indicatori di esposizione ai Rischi di Mercato" in modalità ASP (v. paragrafo 3.1 del Capitolato Tecnico), se esistono restrizioni dell'Istituto nella condivisione verso il Service Provider di dati riguardanti i propri investimenti (es. le posizioni) e/o relativamente anche alla localizzazione del servizio di hosting. In caso affermativo è stato richiesto se sia praticabile per l'Istituto un approccio ibrido ASP (es. la parte centrale del calcolo viene eseguita presso il centro del fornitore della soluzione e una minimale componente applicativa, istanziata presso l'Istituto, si occupa di fondere tali calcoli con i dati "non esportabili" e predisporre i risultati finali).

RISPOSTA

L'approccio ibrido non è accettabile perché richiederebbe un impegno gestionale non previsto ex-ante dalla Banca.

10) È stato richiesto, in relazione al REQ 3.2.1.6 (flusso di dati verso front office WSS), di confermare che non esistono ulteriori necessità di analoghe integrazioni relativamente a flussi di dati generati dal servizio di calcolo del rischio mercato oggetto di gara.

RISPOSTA

Si conferma. Il flusso dei dati dal software verso WSS riguarda solo le volatilità e le correlazioni tra le *asset class* che compongono il portafoglio per il calcolo del VaR parametrico da parte di WSS.

11) È stato richiesto, al fine di un adeguato dimensionamento della piattaforma, di fornire qualche informazione addizionale circa le dimensioni/i volumi del portafoglio oggetto di calcolo. In particolare, è stato chiesto:

- di indicare quanti sono gli strumenti finanziari del tipo derivati OTC e *market-traded securities* che la Banca intende trattare nel contesto della soluzione informatica richiesta in gara e se essi possono eccedere i 15.000 (v. REQ 3.2.3.4);
- quali sono i requisiti richiesti in termini di scenari, per la simulazione Monte Carlo.

RISPOSTA

Al momento il portafoglio della Banca conta meno di 2.000 strumenti. Di questi, i derivati OTC sono nell'ordine delle decine. La possibilità che il numero degli strumenti ecceda i 15.000 è da escludere.

I requisiti richiesti in termini di scenari per la simulazione Monte Carlo sono, indicativamente, almeno 10.000.

12) È stato richiesto, con riferimento ai contenuti forniti da Information Provider, necessari per il *pricing* degli strumenti finanziari (rif. REQ 3.2.2.9), di confermare che il canone previsto da tali soggetti (Reuters, Bloomberg, J.P. Morgan) per accedere ai relativi contenuti viene corrisposto direttamente dall'Istituto in base a rapporti esistenti con tali soggetti e non deve essere considerato nell'ambito dell'offerta da formulare in risposta al bando.

RISPOSTA

Il canone da corrispondere agli Information Provider è a carico dell'offerente e non riguarda in alcun modo i rapporti contrattuali eventualmente già instaurati dalla Banca con gli stessi. Gli information provider non devono essere necessariamente quelli tra parentesi, ma devono essere di elevata qualità e affermato standing.

PER DELEGA DEL DIRETTORE GENERALE

[firma 1]