



*Commissione di Vigilanza  
sui Fondi Pensione*

Ai fondi pensione negoziali autorizzati  
all'esercizio dell'attività

Roma, 23 dicembre 2004  
Prot. n. 4894  
(Trasmissione via e-mail)

Oggetto: Fondi pensione negoziali. Dati relativi all'anno 2004.

Con la presente circolare si richiede ai fondi pensione negoziali di completare la segnalazione dei dati relativi alla propria operatività per il 2004, con particolare riferimento al quarto trimestre dell'anno.

Come preannunciato nella ns. circolare del 5 agosto u.s., le informazioni qui richieste sono organizzate in modo coerente con le precedenti segnalazioni.

Tuttavia, al fine di rilevare alcune informazioni circa la gestione del rischio di cambio, è prevista una integrazione relativa all'esposizione in valuta. In particolare vengono richieste, con riferimento a ciascun mandato di gestione (terza sezione della segnalazione), informazioni relative:

- alle attività in valuta, per le quali sono state introdotte delle voci specifiche inserite nella tavola che contiene la composizione degli investimenti per area geografica;
- alle posizioni derivanti dagli acquisti e vendite a termine di valuta, da inserire nella compilazione delle voci relative alle posizioni su valuta originariamente previste con riferimento agli strumenti derivati, e che ora pertanto assumono un significato più ampio, così come evidenziato nelle istruzioni di compilazione.

Si noti anche che la rilevazione delle voci relative a iscritti e aziende aderenti, distinte sulla base dei diversi contratti collettivi di lavoro, è stata rimandata a una successiva, specifica richiesta, che sarà organizzata con modalità che facilitino una più precisa individuazione dei contratti cui si fa riferimento.

Poiché quest'anno gran parte delle informazioni richieste sono già state rilevate con riferimento ai primi tre trimestri dell'anno in corso, nella presente segnalazione le stesse andranno riferite unicamente al quarto trimestre dell'anno; viceversa le informazioni non rilevate in corso d'anno (caratteristiche e movimenti degli iscritti, conto economico) sono da riferire all'intero anno 2004.

Per la trasmissione delle segnalazioni è prevista la scadenza del **31 gennaio 2005**.

Sul piano tecnico, i dati richiesti dovranno essere obbligatoriamente inviati per via telematica, secondo le modalità utilizzate nella precedente segnalazione, operanti tramite schemi personalizzati messi a disposizione attraverso il sito web della Covip, che prevedono in alternativa:

- l'acquisizione dal sito della Covip di appositi *file* in formato XML, per la compilazione e la successiva trasmissione sempre attraverso sito; ovvero,
- la compilazione diretta di apposite pagine *web* pure messe a disposizione sul sito della Covip.

Qualora i fondi valutino che l'ampiezza del bacino dei propri iscritti risulta significativamente diversa rispetto al dato precedentemente segnalato alla Covip, si richiede di fornire una relazione con il nuovo dato e con esaustive spiegazioni sui motivi della variazione. Tale relazione dovrà essere inviata contestualmente alla segnalazione tramite canale web (sezione documentazione).

In allegato alla presente circolare si accludono:

- le "Istruzioni di compilazione delle segnalazioni", contenenti la lista delle variabili richieste e la descrizione dei contenuti;
- le "Istruzioni tecniche", relative alle modalità per la trasmissione telematica dei dati.

Per eventuali chiarimenti sulla compilazione delle segnalazioni sotto il profilo dei contenuti è possibile contattare Ferdinando Carignani (tel. 06/69506.269), Annamaria D'Alo' (06/69506.264) e Enrico Mattioni (tel. 06/69506.289). Per eventuali chiarimenti riguardo agli aspetti tecnici per l'inoltro per via telematica è possibile contattare Paolo Marini (tel. 06/69506.245) e Giuseppe De Mare (tel. 06/69506.295).

Si prega di fornire comunque tutti i dati richiesti rispettando la scadenza prevista, fornendo ove necessario anche dati solo provvisori.

Distinti saluti.

Il Presidente  
,(Luigi Scimia)