

**INFORMAZIONI RELATIVE AI FONDI ALTERNATIVI ESERCIZIO 20__**

Scheda da compilare per l'insieme dei fondi speculativi e da rinviare all'attenzione di Yulia Goloubeva del Servizio Tecnico, all'indirizzo qui sotto, entro il 31 marzo di ogni anno.

L'obiettivo del presente documento è di permettere alla Compagnia di certificare che i fondi speculativi sono stati sottoposti ad un'analisi professionale..

Durante l'esercizio scorso, ci sono stati investimenti in fondi speculativi? sì no

Se sì, si prega di completare il questionario in integralità.

Se no, si prega di firmare e datare documento.

Esistenza di una procedura

	Sì per tutti i f.s	Spesso	Raramente	Mai
Esiste una procedura interna di selezione e di verifica dei fondi speculativi (f.s.) ?			<input type="checkbox"/> sì	<input type="checkbox"/> no
Se sì, è stata applicata ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Criteri di selezione dei fondi speculativi

Durante la selezione dei fondi :	Sì per tutti i f.s	Spesso	Raramente	Mai
Esiste un'autorità di sorveglianza nel paese domicilio del f.s ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
I fondi sono approvati ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
I fondi sono sottoposti ad una sorveglianza prudenziale ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
I fondi selezionati rispettano tutti i criteri della politica d'investimento del fondo dedicato ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Altri criteri di selezione:				

Analisi quantitativa dei fondi speculativi

Durante la selezione dei fondi :	Sì per tutti i f.s	Spesso	Raramente	Mai
La performance del fondo è stata analizzata ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
La volatilità del fondo è stata analizzata ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Le esposizioni di gestione del fondo sono state analizzate ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Durante l'anno e almeno una volta all'anno:	Sì per tutti i f.s	Spesso	Raramente	Mai
La performance del fondo è stata monitorata ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
La volatilità del fondo è stata monitorata ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Le esposizioni di gestione del fondo sono state monitorate ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Azioni correttive sono state implementate (riscatti, cancellazione dal portafoglio,...)?			<input type="checkbox"/> sì	<input type="checkbox"/> no

Analisi qualitative dei fondi speculativi

Durante la selezione dei fondi :	Sì per tutti i f.s	Spesso	Raramente	Mai
È stata presa in considerazione la legislazione applicabile al fondo ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
La qualità del gestore è stata valutata?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
La dimensione del fondo è stata controllata ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
La strategia d'investimento del fondo è stata analizzata ?	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Altri criteri qualitativi analizzati :	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Durante l'anno e almeno una volta all'anno:	Sì per tutti i f.s	Spesso	Raramente	Mai
I criteri qualitativi e quantitativi sopra menzionati sono stati l'oggetto di follow-up ?			<input type="checkbox"/> sì	<input type="checkbox"/> no

I controlli sopra menzionati sono formalizzati (in documenti scritti o documenti informatici) ? Sì No

Relazione redatta il ___/___/_____

da _____

XXXXXXXXXX

Firma _____