

## **CAPITOLATO TECNICO**

### **Fornitura software DerivRisk**

## INDICE

|          |                                                                                              |          |
|----------|----------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>1</b> | <b>PREMESSA .....</b>                                                                        | <b>3</b> |
| 1.1      | DEFINIZIONI .....                                                                            | 3        |
| <b>2</b> | <b>OGGETTO DELLA FORNITURA E DURATA .....</b>                                                | <b>4</b> |
| 2.1      | SERVIZIO DI MANUTENZIONE E ASSISTENZA .....                                                  | 4        |
| 2.2      | ATTIVITÀ DI SVILUPPO SOFTWARE AD HOC E DI FORMAZIONE SU RICHIESTA SPECIFICA DEL CLIENTE..... | 5        |
| <b>3</b> | <b>MODALITÀ DI ESECUZIONE DEL SERVIZIO .....</b>                                             | <b>5</b> |
| <b>4</b> | <b>GESTIONE DELLA FORNITURA.....</b>                                                         | <b>6</b> |
| 4.1      | RESPONSABILE DELLA FORNITURA .....                                                           | 6        |
| 4.2      | MODALITÀ DI COMUNICAZIONE .....                                                              | 6        |
| <b>5</b> | <b>VERIFICA DI CONFORMITÀ .....</b>                                                          | <b>6</b> |
| <b>6</b> | <b>FATTURAZIONE E MODALITÀ DI PAGAMENTO .....</b>                                            | <b>6</b> |
| <b>7</b> | <b>ADEMPIMENTI PER LA SICUREZZA .....</b>                                                    | <b>7</b> |
| <b>8</b> | <b>PENALI .....</b>                                                                          | <b>7</b> |

## 1 PREMESSA

La Direzione Debito Pubblico del Dipartimento del Tesoro ha necessità di acquisire, nell'espletamento della propria attività, alcuni servizi economico-finanziari attraverso la piattaforma DerivRisk.

DerivRisk consente di effettuare il pricing e la valutazione di strumenti derivati, anche con strutture complesse, tramite le piattaforme attualmente in dotazione al DT.

DerivRisk comprende la fornitura di librerie di calcolo proprietarie sviluppate secondo modelli di pricing evoluti e riconosciuti dal mercato finanziario; garantisce altresì, secondo un approccio Rapid Solution Development, il pricing di strumenti derivati con strutture non standard, attraverso un set di librerie appositamente sviluppate per le esigenze del DT utilizzando template personalizzati.

Gli utenti del Dipartimento del Tesoro (Direzione Debito Pubblico) utilizzano tali librerie per elaborazioni relative al pricing e alla valutazione di strumenti derivati, nell'ambito della strategia di copertura dei rischi di tasso di cambio e di tasso di interesse.

### 1.1 DEFINIZIONI

Nel corpo del documento, ai termini di cui appresso, viene attribuito il significato riportato a fianco di ciascuno di essi:

- CONSIP: la Società che, in qualità di stazione appaltante della presente fornitura, affida la fornitura oggetto del presente Capitolato;
- SOGEI: la Società Generale di Informatica S.p.A, Committente;
- Dipartimento del Tesoro: Dipartimento del Ministero dell'Economia e delle Finanze, beneficiario della fornitura;
- Amministrazione: Si intende il Ministero dell'Economia e delle Finanze, che è proprietario dell'intero capitale di Sogei, con riferimento alle proprie strutture organizzative destinate ai servizi erogati dalla Sogei sia attraverso infrastrutture proprietarie che attraverso infrastrutture proprietarie delle singole strutture organizzative; rientrano nella presente definizione le altre Amministrazioni, ivi compresi gli Enti e le Società Pubbliche per cui Sogei svolge e/o svolgerà per disposizione legislativa o amministrativa (decreto ministeriale, decreto di natura normativa o decreto presidenza consiglio dei ministri), ogni altra attività di natura informatica.
- Capitolato tecnico: il presente documento che enuncia le specifiche tecniche alle quali si dovrà conformare la fornitura;
- Contratto: il contratto che verrà stipulato tra la Sogei e la Società che enuncia le regole giuridiche alle quali si dovrà conformare la fornitura;
- Fornitura: il complesso delle attività oggetto del presente Capitolato;
- Società: la società aggiudicataria della fornitura;
- Malfunzionamento: qualsiasi anomalia funzionale dei prodotti software e, in ogni caso, ogni difformità del prodotto in esecuzione rispetto alla relativa documentazione tecnica e manualistica d'uso.

## 2 OGGETTO DELLA FORNITURA E DURATA

Il servizio richiesto nel presente Capitolato ha per oggetto la fornitura del software DerivRisk, dotato di librerie di calcolo proprietarie e di una specifica interfaccia, per quattro postazioni.

Il software DerivRisk garantisce anche la fornitura di template in formato XLT di pricing di IRS con strutture standard di seguito elencate:

- VANILLA BOND
- VANILLA IRS
- VANILLA CMS
- VANILLA CMS SPREAD
- VANILLA CAP/FLOOR
- GENERIC SPREAD CAP/FLOOR
- VANILLA INFLATION SWAP
- QUANTO SWAP
- CROSS CURRENCY
- CROSS CURRENCY SWAPTION
- IRS con gamba variabile RISK FREE RATES
- CROSS CURRENCY con gamba variabile RISK FREE RATES

Il software DerivRisk è corredato da una macro in formato XLS per il salvataggio dei dati di input tramite le piattaforme in dotazione al Dipartimento del Tesoro per la ricezione in tempo reale dei dati di mercato necessari per i calcoli ad opera delle librerie DerivRisk, fatto salvo che il provider real-time disponga dei dati richiesti dalla libreria software.

DerivRisk infine è in grado di fornire oltre alle valutazioni marked-to-market dello swap anche i principali coefficienti di sensitività (delta, vega, rho) delle relative strutture.

Il fornitore fornirà il sw da remoto, via web tramite apposite credenziali al personale del Dipartimento del Tesoro.

Il contratto avrà durata di 12 mesi, **dal 7 gennaio 2027 al 6 gennaio 2028 e non sarà tacitamente rinnovabile al termine dell'annualità.**

### 2.1 SERVIZIO DI MANUTENZIONE E ASSISTENZA

Il fornitore dovrà garantire, per tutta la durata contrattuale, la manutenzione del software, impegnandosi a risolvere tempestivamente qualsiasi conflitto venisse acclarato sia dal team di sviluppo interno che dal Cliente.

Si riportano di seguito i livelli di servizio richiesti per la risoluzione degli eventuali conflitti:

- la segnalazione dovrà essere recepita entro un'ora dalla sua notifica;

- l'inizio dell'intervento dovrà avvenire entro 4 (quattro) ore dalla notifica e dovrà essere chiuso nell'arco delle 24 (ventiquattro) ore successive alla segnalazione;
- qualora l'intervento di ripristino riguardi direttamente gli algoritmi di librerie di calcolo, l'intervento dovrà avvenire entro 5 (cinque) giorni lavorativi dalla segnalazione.

Qualora, in contraddittorio tra la Società aggiudicataria e Sogei, si accerti che per la correzione del malfunzionamento e/o dell'anomalia segnalati siano necessari tempi superiori a quelli indicati, verrà concordato, entro la scadenza dei termini, un nuovo tempo per la correzione, provvedendo a riportare in apposita nota, sottoscritta dal Responsabile della Fornitura di cui al paragrafo 4.1, il nuovo termine concordato per la correzione stessa.

La Società dovrà fornire una soluzione temporanea al malfunzionamento, che assicuri in ogni caso l'esecuzione di prestazioni equivalenti e comunque conformi ai requisiti tecnici garantiti, e mantenere costantemente informato il Cliente circa l'avanzamento delle azioni intraprese e dei risultati conseguiti per la diagnosi e la correzione del malfunzionamento e/o dell'anomalia.

La Società dovrà inoltre fornire, per tutta la durata contrattuale, il servizio di assistenza telefonica agli utenti diretti delle postazioni software installate presso il Dipartimento del Tesoro.

Il servizio di assistenza telefonica dovrà essere reso disponibile dalle ore 9.00 alle ore 18.00 dei giorni feriali. Gli utenti potranno altresì richiedere assistenza direttamente via e-mail su apposita casella di posta resa disponibile dal fornitore. Per la ricezione del materiale concernente la manutenzione e l'assistenza, il beneficiario dovrà costituire un'apposita casella di posta.

Ad eccezione della prima installazione, non è inclusa l'assistenza in loco per la re-installazione del software o per l'installazione di aggiornamenti successivi. La risoluzione di eventuali conflitti di sistema operativo su ogni singola postazione di DerivRisk dovrà essere risolta – tramite assistenza telefonica di 1° livello – direttamente da specialisti di sistemi del Ministero.

## **2.2 ATTIVITÀ DI SVILUPPO SOFTWARE AD HOC E DI FORMAZIONE SU RICHIESTA SPECIFICA DEL CLIENTE**

È facoltà del Cliente richiedere per tutta la durata contrattuale, l'adeguamento dei moduli esistenti per la valutazione di strumenti derivati su tassi (ad es. dovuto a cambiamenti nelle convenzioni di mercato). Le implementazioni adeguate del software, realizzate dal fornitore per il miglioramento del software stesso, verranno gratuitamente rilasciate al Cliente.

Successivamente al rilascio di nuove versioni del software, dovrà essere garantito l'aggiornamento del manuale in linea e della documentazione relativa ai campi in uso dalle singole funzioni della libreria software.

È altresì facoltà del Cliente richiedere, per tutta la durata contrattuale, l'eventuale erogazione da remoto di giornate di formazione, rivolta agli utenti delle postazioni software installate presso il Dipartimento del Tesoro.

## **3 MODALITÀ DI ESECUZIONE DEL SERVIZIO**

Le librerie proprietarie di DerivRisk saranno rese disponibili via web al personale del Dipartimento del Tesoro, tramite postazioni dedicate che accedono alle librerie proprietarie di DerivRisk e apposite credenziali che saranno fornite all'Amministrazione.

I dati saranno elaborati presso il Dipartimento del Tesoro nella sede di via XX Settembre 97, 00187 Roma.

Il fornitore si impegna a non utilizzare o condividere le informazioni personali o i dati del Cliente acquisiti nella fornitura e nell'erogazione dei servizi di manutenzione e assistenza del software, se non dai propri collaboratori autorizzati e solo per finalità relative ai servizi forniti.

## **4 GESTIONE DELLA FORNITURA**

### **4.1 RESPONSABILE DELLA FORNITURA**

La Società dovrà comunicare a Consip, trasmettendolo con la documentazione per la stipula, il nominativo del Responsabile della Fornitura, nonché un numero di telefono e un indirizzo e-mail al quale indirizzare eventuali comunicazioni. La Società deve provvedere in piena autonomia al coordinamento e all'organizzazione delle attività nel rispetto delle specifiche e dei tempi forniti da Sogei.

Sarà compito del Responsabile curare la gestione amministrativa del contratto e delle attività legate alla fatturazione e verificare il rispetto di tutti gli adempimenti contrattuali, curando in particolare il rispetto dei tempi e delle modalità di consegna delle nuove release, degli aggiornamenti dei prodotti software e della relativa documentazione.

### **4.2 MODALITÀ DI COMUNICAZIONE**

La Società si impegna a comunicare a Consip, contestualmente alla presentazione della documentazione per la stipula, un indirizzo e-mail, un indirizzo pec e un numero di telefono al quale rivolgersi, senza alcun limite sul numero di chiamate, per ogni comunicazione relativa alla fornitura.

Resta inteso che, per tutta la durata contrattuale, la Società dovrà garantire la piena funzionalità dei suddetti mezzi di comunicazione, informando tempestivamente circa eventuali modifiche.

La Società dovrà rilasciare le informazioni richieste di cui ai paragrafi 4.1 e 4.2 attraverso la compilazione del documento denominato "Scheda anagrafica e tracciabilità Sogei".

## **5 VERIFICA DI CONFORMITÀ**

La verifica di conformità verrà eseguita una volta che siano state ultimate le attività di attivazione oggetto del contratto.

La verifica di conformità verrà eseguita direttamente dal Responsabile Sogei in contraddittorio con il Responsabile della Fornitura.

La verifica di conformità si intende positivamente superata solo se tutte le prestazioni contrattuali siano state eseguite a perfetta regola d'arte e secondo la documentazione tecnica e d'uso fornita dall'Impresa.

Solo a seguito della positiva verifica di conformità verrà emesso il relativo verbale, la cui data, in caso di esito positivo, verrà considerata come data di accettazione.

## **6 FATTURAZIONE E MODALITÀ DI PAGAMENTO**

Il pagamento del corrispettivo verrà effettuato previa presentazione di apposita fattura, che dovrà essere emessa per l'intero importo del contratto alla stipula dello stesso.

## **7 ADEMPIMENTI PER LA SICUREZZA**

La Società aggiudicataria si impegna a porre in essere quanto necessario per garantire l'esecuzione delle attività in piena aderenza con le disposizioni del D.lgs. 81/2008 "Testo Unico sulla sicurezza durante il lavoro", cooperando e coordinandosi, in particolare, con i referenti della Committente, ai fini degli adempimenti di cui al comma 2 dell'art. 26 del citato decreto.

## **8 PENALI**

Sogei applicherà le penali, secondo i seguenti casi:

- per ogni giorno solare di ritardo rispetto al termine previsto per la risoluzione dei malfunzionamenti in base ai livelli di servizio definiti al paragrafo 2.1, Sogei applicherà una penale pari allo 0,1% (zerovirgolaunopercento) dell'importo contrattuale complessivo.

Nell'ipotesi che l'importo delle penali applicabili superi l'ammontare del 10% (diecipercento) dell'importo contrattuale complessivo, Sogei avrà il diritto di risolvere il contratto, totalmente o parzialmente, in danno alla Società aggiudicataria, salvo il diritto al risarcimento dell'eventuale maggior danno.