

## **ALLEGATO 4**

### SCHEMA PROPOSTA DI ACCORDO DI PORTAFOGLIO

**Avviso per l'individuazione di intermediari finanziari finalizzato all'impiego in operazioni "Tranched Cover" delle risorse finanziarie del Programma Operativo Regionale 2007-2013 - Fondo Europeo di Sviluppo Regionale (F.E.S.R.) – linea di attività 1.2.4 "Ingegneria Finanziaria" "Fondo Tranched Cover Liguria"**

### **"PROPOSTA DI ACCORDO DI PORTAFOGLIO"**

**SOGGETTO PROPONENTE:** \_\_\_\_\_

#### **1) Presentazione del soggetto proponente**

- *Forma e composizione societaria, struttura operativa, posizionamento sul mercato, risultati e dati conseguiti a livello globale.*
- *Presenza e operatività sul territorio regionale, volumi conseguiti e modalità operative sul territorio regionale.*
- *Esperienze significative su operazione di cartolarizzazione tradizionali e/o sintetiche con strutture di tipo tranched cover (volumi, ambiti territoriali, ecc).*
- *Presentazione di eventuali terze società che collaborano alla realizzazione dell'operazione finanziaria, e del rapporto funzionale intercorrente con esse.*
- *(In caso di raggruppamento temporaneo di imprese): quote di partecipazione e caratteristiche del raggruppamento.*

#### **2) Caratteristiche del Portafoglio proposto**

- *Ammontare del Portafoglio € ..... (dato vincolante ai fini dell'ammissibilità del Portafoglio).*
- *Spessore della Tranche Junior proposto: \_\_\_%, conseguente dimensione della Tranche, pari a € \_\_\_\_\_, ammontare del relativo Cash Collateral, ovvero Lotto Finanziario richiesto, pari a € \_\_\_\_\_ (dati vincolanti ai fini dell'ammissibilità del Portafoglio).*
- *Composizione del Portafoglio ipotizzato relativamente a: distribuzione di rating, distribuzione settoriale, distribuzione geografica, granularità e durata dei finanziamenti, classi dimensionali dei beneficiari (dati non vincolanti ai fini dell'ammissibilità del portafoglio, ma di compilazione obbligatoria).*
- *Condizioni economiche dei finanziamenti, per classe di merito creditizio interno,*

corrispondenti alle classi di merito indicate nella Tabella che segue (dati vincolanti ai fini dell'ammissibilità del Portafoglio).

Classe di rating	(A)	(B)	(AxB)	
Standard & Poor's	Fitch	Moody's	Fattore di ponderazione	Tasso offerto
AAA	AAA	Aaa	0,25	
AA+	AA+	Aa	0,25	
AA	AA	Aa	0,25	
AA-	AA-	Aa	0,25	
A+	A+	A 1	1,00	
A	A	A	1,00	
A-	A-	A 3	1,00	
BBB+	BBB+	Baa 1	5,00	
BBB	BBB	Baa 2	5,00	
BBB-	BBB-	Baa 3	5,00	
BB+	BB+	Ba 1	12,00	
BB	BB	Ba 2	12,00	
BB-	BB-	Ba 3	12,00	
B+	B+	B 1	12,00	
B	B	B 2	12,00	
B-	B-	B 3	12,00	

- Condizioni applicate al Conto Vincolato presso il quale verrà depositato il Cash Collateral (dato vincolante ai fini dell'ammissibilità del Portafoglio), da esprimere nella forma di Euribor a 3m + spread.