

# Manuale EMIR reporting

Nuovi RTS ed ITS (in vigore dal 1° Novembre 2017)

Versione 1.0 – 22/09/2017



**London**  
Stock Exchange Group



## 1.0 Version control

Versione	Descrizione
Versione 1.0 – 22/09/2017	<p>Prima versione a copertura delle modifiche sul nuovo standard in vigore da 1 Novembre 2017.</p> <p>Sono state eseguite le modifiche di seguito riportate rispetto alla versione precedente:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- Modifiche al paragrafo “Introduzione”</li><li>- Aggiunta della sezione “Dati comuni” contenente le nuove regole di reporting per lo standard RTS 2.0</li><li>- Modifiche al layout.</li></ul>



---

<b>2.0</b>	<b>Indice</b>	
<b>1.0</b>	<b>VERSION CONTROL</b>	<b>3</b>
<b>2.0</b>	<b>INDICE</b>	<b>4</b>
<b>3.0</b>	<b>INTRODUZIONE</b>	<b>6</b>
<b>4.0</b>	<b>IDENTIFICATIVI DI TRADE, POSIZIONI E CONTROPARTI</b>	<b>7</b>
4.1	Identificativo delle operazioni per trade	7
4.2	Identificativo delle operazioni per posizioni	7
4.3	Identificativo delle controparti	8
<b>5.0</b>	<b>DATI COMUNI</b>	<b>9</b>
<b>6.0</b>	<b>WORKFLOW</b>	<b>15</b>
6.1	Trade Give-Up	15
6.2	Trade Split	15
6.3	Cascading	15
6.4	Position Transfer	15
6.5	Early Exercise Request	16
6.6	Expiration Day Exercises	16
6.7	Assignment	16
6.8	Position Rectification	16
6.9	Client Code Change	16
6.10	Corporate Events	16
<b>7.0</b>	<b>ESEMPI</b>	<b>18</b>
7.1	Trade UTI	19
7.2	Position UTI	19



<b>7.3</b>	<b>Give-Up UTI</b>	<b>19</b>
<b>7.4</b>	<b>Trade Split UTI</b>	<b>19</b>
<b>7.5</b>	<b>Cascading UTI</b>	<b>20</b>
<b>7.6</b>	<b>Position transfer UTI</b>	<b>21</b>
<b>7.7</b>	<b>Early Exercise UTI</b>	<b>21</b>
<b>7.8</b>	<b>Expiration Day Exercises UTI</b>	<b>22</b>
<b>7.9</b>	<b>Assignment UTI</b>	<b>22</b>
<b>7.10</b>	<b>Corporate Event UTI</b>	<b>22</b>
<b>8.0</b>	<b>REPORTING DELEGATO</b>	<b>23</b>



---

### 3.0 Introduzione

Lo scopo di questo documento è quello di fornire informazioni relative alle nuove regole di reporting introdotte dai nuovi RTS ed ITS ai sensi dell'articolo 9 di EMIR, e di consolidare le informazioni già disponibili per le regole vigenti.

Gli emendamenti relativi a RTS ed ITS entrano in vigore il 1 Novembre 2017 ed hanno come punti di interesse l'introduzione di nuovi campi per asset class specifiche e le modifica al reporting di posizioni e collaterale.

Il documento si focalizza sui seguenti argomenti:

- Identificativi di trade, posizioni e controparti
- Dati comuni
- Workflow
- Esempi
- Reporting delegato

Il contenuto del documento è da considerarsi soggetto a modifiche connesse ad esempio alla pubblicazione di nuovo materiale regolamentare. Ogni eventuale modifica sarà evidenziata nella sezione relativa al version control.



## 4.0 Identificativi di trade, posizioni e controparti

### 4.1 Identificativo delle operazioni per trade

Per definire un record a livello di trade si utilizza un identificativo unico, denominato UTI (Unique Trade Identifier), definito da CC&G e condiviso con i suoi partecipanti (Tabella 2, Sezione 2c, Campo no12 "Trade ID" di RTS).

La tabella che segue fornisce le regole per la generazione del codice UTI (nessuna modifica è stata introdotta con i nuovi RTS rispetto alla versione precedente):

Nome campo	Lunghezza	Descrizione	Corrispettivo campo API BCS API
MIC Code	10	Valore fisso: "000CGIT000"	
Participant code	5	Codice ABI che identifica il partecipante da cui proviene il trade.	NotifyContract/Abicode
Trade Date	8	Data del Trade nel formato "YYYYMMDD"	NotifyContract/ContractDate
Product ID	12	ISIN Code del prodotto scambiato	NotifyContract/ISINCode
Trade number	12	Numero di contratto Contract number, completato a sinistra con degli zeri	NotifyContract/ContractNumber
Trade indicator	1	B=Buy S=Sell (dal punto di vista del Partecipante)	NotifyContract/Side
Chain indicator	1	Tutti i trade scambiati con CC&G come controparte devono essere riportati con valore fisso a "C".	

I codici UTI possono essere reperiti dal report *D01R – Derivatives Contracts* del Data Service di CC&G (campo "UTI"). Per informazioni aggiuntive su altri report contenenti i codici UTI si può far riferimento al *Data Service Manual* sul sito di CC&G.

### 4.2 Identificativo delle operazioni per posizioni

Un identificativo unico per posizioni, denominato UTI (Unique Trade Identifier) definito da CC&G e condiviso con i suoi partecipanti, viene utilizzato per:

- segnalare record a livello di posizione (Tabella 2, Sezione 2c, Campo 2.12 "Trade ID" degli RTS).

- segnalare record a livello di trade (questo codice deve essere utilizzato per referenziare la corrispondente posizione nella Tabella 2, Sezione 2c, Campo 13 "Report tracking number" degli RTS rispetto alla versione precedente).



La tabella che segue fornisce le regole per la generazione del codice (nessuna modifica è stata introdotta con i nuovi RTS rispetto alla versione precedente):

Nome campo	Lunghezza	Descrizione	Corrispettivo campo API BCS API
MIC Code	10	Valore fisso: "000CGIT000"	
Separator	1	Popolare con il carattere "-"	
Participant code	5	Codice ABI che identifica il partecipante da cui proviene il trade.	NotifyContract/Abicode
Account	1	Può essere popolato con "H" per house accounts, o "C" per client accounts.	NotifyPositions /Accounttype
Sub-Account	4	Codice sottoconto. L'asterisco "*" nell'omnibus account deve essere sostituito con il carattere underscore "_" (Eg. "_OMN"). L' API ritorna il codice con il carattere asterisco.	NotifyPositions /SubAccount
Product ID	12	ISIN Code del prodotto scambiato	NotifyContract/ISINCode

Le posizioni sono generate da CC&G su base netta. Una quantità negativa rappresenta una posizione short.

I codici UTI per le posizioni possono essere reperiti dal report *D13R – CCP Positions* del Data Service di CC&G (campo "UTI"). Per informazioni aggiuntive su altri report contenenti i codici UTI ci si può riferire al *Data Service Manual* sul sito di CC&G.

### 4.3 Identificativo delle controparti

Ogni controparte deve essere identificata dal proprio codice LEI (Legal Entity Identifier), standard ISO 17442, registrato e mantenuto nel database GLEIF. I partecipanti devono tempestivamente comunicare a CC&G ogni cambiamento nel codice utilizzato per il reporting.

CC&G è registrata sul database GLEIF con il codice:

**8156006407E264D2C725**





## 5.0 Dati comuni

Questa sezione si riferisce ad una selezione di campi relativi alla *Tabella 2 – Common Data dei Revised RTS*. Per i suddetti campi, CC&G fornisce i dettagli relativi al valore atteso per i record definiti a livello di trade. Per i record definiti a livello di posizioni molti campi possono essere lasciati vuoti, coerentemente con le specifiche di workflow e con le regole di validazione dei trade repositories.

RTS numero di riferimento	RTS nome campo	RTS descrizione campo	Campo Nuovo/Esistente	Valore concordato	Sample
2.3	Product classification type	Il tipo di classificazione del prodotto pertinente	Nuovo	Popolato con 'C' (CFI Code).	C
2.4	Product classification	Per i prodotti identificati tramite il codice ISIN (International Securities Identification Number — numero internazionale di identificazione dei titoli) o mediante codice alternativo di identificazione degli strumenti finanziari (Alternative Instrument Identifier — AI), specificare il codice CFI (Classification of Financial Instruments — classificazione degli strumenti finanziari). Per i prodotti per i quali non è disponibile né ISIN né AI, specificare l'identificativo unico del prodotto (Unique Product Identifier — UPI) approvato. Fino all'approvazione dell'UPI detti prodotti sono classificati con il codice CFI.	Esistente	Popolato con il codice CFI dello strumento finanziario (Ref. Public Data Services - report 'cficode')	FFICSX
2.5	Product identification type	Il tipo di identificazione del pertinente prodotto.	Nuovo	Popolato con 'I' (codice ISIN)	I



RTS numero di riferimento	RTS nome campo	RTS descrizione campo	Campo Nuovo/Esistente	Valore concordato	Sample
2.6	Product identification	Il prodotto è identificato mediante ISIN o All. Utilizzare un codice All se il prodotto è negoziato in una sede di negoziazione classificata con codice All nel registro pubblicato sul sito web dell'ESMA e istituito sulla base delle informazioni fornite dalle autorità competenti ai sensi dell'articolo 13, paragrafo 2, del regolamento (CE) n. 1287/2006 della Commissione (1). Il codice All è utilizzato solo fino alla data di applicazione dell'atto delegato adottato dalla Commissione ai sensi dell'articolo 27, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 600/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio.	Nuovo	Popolato con il codice ISIN dello strumento derivato.	IT0003465736
2.7	Underlying identification type	Il tipo di identificativo del pertinente sottostante.	Esistente	Vuoto nel caso di Commodity Derivatives (Field 2.2 = 'CO' Commodity). Altrimenti popolato con: 'X': strumenti aventi un indice come sottostante 'B': basket di strumenti 'I': tutti gli altri casi	I
2.8	Underlying identification	Il sottostante diretto è identificato mediante un identificativo unico del sottostante sulla base del suo tipo. Il codice All è utilizzato solo fino alla data di applicazione dell'atto delegato adottato dalla Commissione ai sensi dell'articolo 27, paragrafo 3, del regolamento (UE) n. 600/2014. Per i credit default swap indicare il codice ISIN dell'obbligazione di riferimento. Per i panieri composti, tra gli altri, di strumenti finanziari negoziati in una sede di negoziazione, specificare solo gli strumenti finanziari negoziati nella sede di negoziazione.	Esistente	Vuoto nel caso di Commodity Derivatives (Field 2.2 = 'CO' Commodity). Altrimenti sarà popolato con il codice ISIN dello strumento sottostante.	IT0003465736



RTS numero di riferimento	RTS nome campo	RTS descrizione campo	Campo Nuovo/Esistente	Valore concordato	Sample
2.9	Notional currency 1	Valuta dell'importo nozionale. Per i contratti derivati su tassi di interesse o valute corrisponde alla valuta nozionale della gamba 1.	Esistente	Popolato con ('EUR') (per gli strumenti attualmente garantiti)	EUR
2.10	Notional currency 2	L'altra valuta dell'importo nozionale. Per i contratti derivati su tassi di interesse o valute corrisponde alla valuta nozionale della gamba 2.	Esistente	Vuoto (per gli strumenti attualmente garantiti)	
2.11	Deliverable currency	La valuta da consegnare.	Esistente	Popolato con 'EUR' (per gli strumenti attualmente garantiti)	EUR
2.12	Trade ID	Finché non sarà disponibile l'UTI globale, il codice unico dell'operazione concordato con l'altra controparte.	Esistente	Popolato con il codice dell'operazione nel caso di operazioni eseguite a livello di trade (campo 2.94 Level = 'T'). Popolato con il codice dell'operazione per posizioni nel caso di operazioni a livello di posizioni (campo 2.94 Level = 'P').	000CGIT0001 23452017070 3IT111326228 90000000185 39SC
2.13	Report tracking number	Un numero unico per il gruppo di segnalazioni che si riferiscono all'esecuzione di uno stesso contratto derivato.	Nuovo	Popolato con il codice dell'operazione per posizioni nel caso di operazioni eseguite a livello di trade (campo 2.94 Level = 'T'). Vuoto per operazioni a livello di di posizioni (campo 2.94 Level = 'P').	000CGIT000- 12345C_OMN IT0023373259



RTS numero di riferimento	RTS nome campo	RTS descrizione campo	Campo Nuovo/Esistente	Valore concordato	Sample
2.14	Complex trade component ID	Identificativo, interno all'impresa che effettua la segnalazione, che consente di identificare e collegare tutte le segnalazioni attinenti allo stesso contratto derivato costituito da una combinazione di contratti derivati. Il codice deve essere unico a livello della controparte per il gruppo di segnalazioni delle operazioni risultanti dal contratto derivato. Campo applicabile solo se l'impresa esegue un contratto derivato composto da due o più contratti derivati e il contratto non può essere adeguatamente segnalato con un'unica segnalazione.	Nuovo	Vuoto (per gli strumenti attualmente garantiti)	
2.16	Compression	Indicare se il contratto risulta da un'operazione di compressione ai sensi dell'articolo 2, paragrafo 1, punto 47, del regolamento (UE) n. 600/2014.	Esistente	Popolato con 'N' per gli strumenti attualmente garantiti.	N
2.18	Price notation	Il modo in cui è espresso il prezzo.	Esistente	Popolato con 'U' per gli strumenti attualmente garantiti.	U
2.20	Notional	L'importo di riferimento sulla base del quale sono determinati i pagamenti contrattuali. Per quanto riguarda le cessazioni parziali, gli ammortamenti e i contratti in cui il valore nozionale, a causa delle caratteristiche del contratto, varia nel tempo, indicare il nozionale residuo dopo la variazione.	Esistente	Popolato con il valore nozionale che sarà differente per futures e options:  Futures: [multiplier] x [market price] x [quantity] Options: [multiplier] x [strike price] x [quantity]  (Market Price ref. Public Data Service - Report 'serinf' - field 'Mark Price').	3434324
2.23	Up-front payment	Importo di eventuali pagamenti anticipati che la controparte segnalante ha effettuato o ricevuto.	Esistente	Vuoto (per gli strumenti attualmente garantiti)	
2.25	Execution timestamp	Data e ora di esecuzione del contratto.	Esistente	Popolato con la data e ora del contratto (Ref. Data Service - report D01R - 'Date' and 'Contract time' fields)	2017-07-03T07:00:12Z



RTS numero di riferimento	RTS nome campo	RTS descrizione campo	Campo Nuovo/Esistente	Valore concordato	Sample
2.26	Effective date	Data alla quale le obbligazioni contrattuali entrano in vigore.	Esistente	Popolato con la data del contratto (Ref. Data Service - report D01R - 'Date' field)	2017-07-03
2.27	Maturity date	Data originaria di scadenza del contratto segnalato. La cessazione anticipata non può essere segnalata in questo campo.	Esistente	Popolato con la data di scadenza del (Ref. Data Service - report D01R - 'Expiry' field)	2017-10-27
2.28	Termination date	Data di cessazione in caso di cessazione anticipata del contratto segnalato.	Esistente	Popolato con la data e ora del contratto (Ref. Data Service - report D01R - 'Date' field) .	2017-07-03
2.29	Settlement date	Data del regolamento del sottostante. Se più di una, utilizzare più campi.	Esistente	Popolato con la data e ora del contratto (Ref. Data Service - report D01R - 'Date')	2017-07-03
2.32	Confirmation timestamp	La data e l'ora della conferma, come stabilito all'articolo 12 del regolamento delegato (UE) n. 149/2013 della Commissione.	Esistente	Popolato con la data e ora del contratto (Ref. Data Service - report D01R - 'Date' and 'Contract time' fields)	2017-07-03T07:00:12Z
2.33	Confirmation means	Indicare se il contratto è stato confermato per via elettronica, per via non elettronica o se non è stato confermato.	Esistente	Popolato con 'E'	E
2.34	Clearing obligation	Indicare se il contratto segnalato appartiene a una classe di derivati OTC dichiarata soggetta all'obbligo di compensazione e se entrambe le controparti del contratto sono soggette all'obbligo di compensazione ai sensi del regolamento (UE) n. 648/2012 al momento dell'esecuzione del contratto.	Esistente	Vuoto (per gli strumenti attualmente garantiti)	
2.35	Cleared	Indicare se la compensazione ha avuto luogo.	Esistente	Popolato con 'Y'.	Y
2.36	Clearing timestamp	Data e ora in cui la compensazione ha avuto luogo.	Esistente	Popolato con la data e ora del contratto (Ref. Data Service - report D01R - 'Date' and 'Contract time' fields)	2017-07-03T07:00:12Z
2.37	CCP	Se il contratto è stato compensato, indicare il codice unico della CCP che ha compensato il contratto.	Esistente	Popolato con il LEI ISO 17442 di CC&G	8156006407E 264D2C725



RTS numero di riferimento	RTS nome campo	RTS descrizione campo	Campo Nuovo/Esistente	Valore concordato	Sample
2.81	Strike price notation	Il modo in cui è espresso il prezzo strike.	Nuovo	Popolato con 'U' per le opzioni. Altrimenti sarà lasciato vuoto.	U
2.82	Maturity date of the underlying	Per le swaption, la data di scadenza dello swap sottostante.	Nuovo	Vuoto (per gli strumenti attualmente garantiti)	

Quei campi che appartengono alle citate sezioni e relativi ad asset classes che non sono garantite da CC&G dovranno essere lasciati vuoti (e.g., Section 2f - Interest Rates, 2g – Foreign Exchange, 2h – Commodities or emission allowances, Section 2j – Credit derivatives).



---

## 6.0 Workflow

### 6.1 Trade Give-Up

Il Trade Give-Up viene segnalato solo se eseguito nella business date successiva alla data di esecuzione del contratto. In caso di Give-Up eseguiti il giorno di esecuzione del contratto, CC&G riporta il titolare finale della negoziazione.

In caso di Trade Give-Up sono generati due record:

- Cancellazione del trade originale per il partecipante che esegue il Give-Up del contratto
- Nuovo trade con il destinatario finale della negoziazione (sarà assegnato un nuovo identificativo di trade)

Il codice identificativo del partecipante può essere recuperato tramite la BCS API:  
*NotifyContractTransfer/ReceiverAbiCode*

### 6.2 Trade Split

Il Trade Split viene segnalato solo se eseguito nella business date successiva alla data di esecuzione del contratto.

In caso di Trade Split sono generati due record:

- Cancellazione del trade originale
- Nuovo trade, dove il numero di contratto, contenuto nel codice UTI, è fornito dalla BSC API *NotifySubSplitContracts/ContractNumber(N)* con N che varia da 1 ad 8 in funzione del numero di nuovi contratti creati.

### 6.3 Cascading

L'evento di Cascading è gestito solo sull' IDEX Market.

Il numero di contratto per la creazione dell'UTI del nuovo trade è fornito dalla BCS API *NotifyContracts/ContractNumber*.

### 6.4 Position Transfer

In caso di Position Transfer sono generati due record:

1. Un trade per la chiusura della posizione del partecipante che effettua il trasferimento della posizione
2. Un trade per l'apertura della posizione del partecipante che riceve la posizione



Per queste fattispecie di trade i codici UTI sono ottenuti tenendo in considerazione due regole aggiuntive:

- In entrambi i casi il numero di contratto è definito come: Account Code (posizione 1) + due caratteri fissi '00' (posizione da 2 a 3) + il valore restituito dalla BCS API NotifyPositionTransfer/RequestKey (posizioni da 4 a 12)
- Il *trade indicator* sarà uguale ad 'S' per il partecipante cedente e 'B' per il partecipante ricevente in caso di posizioni long, vice-versa in caso di posizioni short.

### 6.5 Early Exercise Request

Viene rappresentato come un trade con il partecipante che esercita dove il codice UTI è ottenuto tenendo in considerazione due regole aggiuntive:

- Il numero di contratto è definito come: Account Code (posizione 1) + Subaccount Code (posizione da 2 a 5), sette caratteri fissi '0000000' (posizione da 6 a 12)
- Il *trade indicator* è fisso ad 'S'

### 6.6 Expiration Day Exercises

Viene rappresentato come un trade con il partecipante che esercita dove il codice UTI è ottenuto tenendo in considerazione due regole aggiuntive:

- Il numero di contratto è definito come: Account Code (posizione 1) + Subaccount Code (posizione da 2 a 5), sette caratteri fissi '0000000' (posizione da 6 a 12)
- Il *trade indicator* è fisso ad 'S'

### 6.7 Assignment

È riportato come un trade sul partecipante assegnato dove il codice UTI è ottenuto tenendo in considerazione due regole aggiuntive:

- Il numero di contratto è definito come: Account Code (posizione 1) + Subaccount Code (posizione da 2 a 5), sette caratteri fissi '0000000' (posizione da 6 a 12)
- Il *trade indicator* è fisso a 'B'

### 6.8 Position Rectification

Non rilevante. Non modifica la posizione netta risultante.

### 6.9 Client Code Change

Non rilevante.

### 6.10 Corporate Events

Un corporate event è gestito segnalando due trade in cui il primo chiude la posizione originale mentre il secondo apre quella rettificata.





Il codice UTI è ottenuto tenendo in considerazione due regole aggiuntive:

- Il numero di contratto della posizione originale è definito come: Account Code (posizione 1) + Subaccount Code (posizione da 2 a 5), sette caratteri fissi '2359591' (posizione da 6 a 12)
- Il numero di contratto della posizione rettificata è definito come: Account Code (posizione 1) + Subaccount Code (posizione da 2 a 5), sette caratteri fissi '2359592' (posizione da 6 a 12)



---

## 7.0 Esempi

Gli esempi forniti in questa sezione sono basati sul campione di dati che segue:

**Trade Date:** 06 Jan 2014

**Product ID:** IT0123456789

**Trade Number:** ABCDEF123456

**Buyer Code:** 12345

**Buyer Account:** House

**Buyer Subaccount:** \*OMN

**Seller Code:** 54321

**Seller Account:** Client

**Seller Subaccount:** SUB1



### 7.1 Trade UTI

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	12345	20140106	IT0123456789	ABCDEF123456	B	C
000CGIT000	54321	20140106	IT0123456789	ABCDEF123456	S	C

### 7.2 Position UTI

Mic Code	Position Indicator	Participant Code	Account	Subaccount	Product ID
000CGIT000	L	12345	H	_OMN	IT0123456789
000CGIT000	S	54321	C	SUB1	IT0123456789

### 7.3 Give-Up UTI

In caso di Give-Up eseguito dal partecipante 12345 e ricevuto dal partecipante 13679 il corrispondente lifecycle event è quello che segue. La prima riga si riferisce alla cancellazione mentre la seconda al nuovo trade:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	12345	20140106	IT0123456789	ABCDEF123456	B	C
000CGIT000	13579	20140106	IT0123456789	ABCDEF123456	B	C

### 7.4 Trade Split UTI

Nel caso di uno split eseguito il giorno dopo la data di esecuzione del trade dal partecipante 54321 il corrispondente lifecycle event è quello che segue. La prima riga si riferisce alla cancellazione mentre la seconda al nuovo trade:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	54321	20140106	IT0123456789	ABCDEF123456	S	C



Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	54321	20140106	IT0123456789	CCG800020	S	C
000CGIT000	54321	20140106	IT0123456789	CCG800021	S	C
000CGIT000	54321	20140106	IT0123456789	CCG800022	S	C

## 7.5 Cascading UTI

Il Cascading Event è gestito dal Energy Derivatives Market.

Il cascading event, gestito solo per l' Idex Market, deve essere adeguatamente segnalato.

Quando una posizione annuale o trimestrale scade, vengono create nuove posizioni basate su prodotti differenti, come definite nel regolamento Idex.

Nell'esempio che segue una posizione annuale viene sostituita con tre posizioni trimestrali e tre posizioni mensili:

### Annual Position expiring (i.e 2013)

Product ID: ITEDA2013001

Participant Code: 67890

Participant Account: House

Participant Subaccount: \*OMN

Position Type: Short

### New Monthly First Expiration (i.e. Jan 2014)

Product ID: ITEDM2014001

### New Monthly Second Expiration (i.e. Feb 2014)

Product ID: ITEDM2014002

### New Monthly Third Expiration (i.e. Mar 2014)

Product ID: ITEDM2014003

### New Quarterly First Expiration (i.e. Mar 2014)

Product ID: ITEDQ2014001

### New Quarterly Second Expiration (i.e. Jun 2014)

Product ID: ITEDQ2014002



New Quarterly Third Expiration (i.e. Sep 2014)

Product ID: ITEDQ2014003

Il numero di contratto è assegnato da CC&G quando il Cascading viene eseguito. Il campione di record che segue si riferisce a nuovi trade:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	67890	20131227	ITEDM2014001	CCG8500001	S	C
000CGIT000	67890	20131227	ITEDM2014002	CCG8500002	S	C
000CGIT000	67890	20131227	ITEDM2014003	CCG8500003	S	C
000CGIT000	67890	20131227	ITEDQ2014001	CCG8500004	S	C
000CGIT000	67890	20131227	ITEDQ2014002	CCG8500005	S	C
000CGIT000	67890	20131227	ITEDQ2014003	CCG8500006	S	C

**7.6 Position transfer UTI**

Nel caso di trasferimento di una posizione short eseguito dal partecipante 12345, House Account, e ricevuto dal partecipante 13579, Client Account, il corrispondente lifecycle event è quello che segue:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	12345	20140107	IT0123456789	H00173027001	B	C
000CGIT000	13579	20140107	IT0123456789	C00173027001	S	C

**7.7 Early Exercise UTI**

Nel caso di un Early Exercise su una posizione long eseguito dal partecipante 12345, House Account, sottoconto \*OMN, il codice UTI del corrispondente lifecycle event è quello che segue:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	12345	20140107	IT0123456789	H_OMN0000000	S	C



### 7.8 Expiration Day Exercises UTI

Nel caso di esercizio in data di scadenza di una posizione long eseguita dal partecipante 12579, Client Account, sottoconto SUB1, il codice UTI del corrispondente lifecycle event è quello che segue.:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	13579	20140107	IT0123456789	CSUB10000000	S	C

### 7.9 Assignment UTI

Nel caso di assegnazione di una posizione short ricevuta dal partecipante 12345, Client Account, sottoconto SUB2, il codice UTI del corrispondente lifecycle event è quello che segue:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	12345	20140107	IT0123456789	CSUB20000000	B	C

### 7.10 Corporate Event UTI

Nel caso di corporate event su una posizione short tenuta dal partecipante 12345, Client Account, sottoconto SUBA, il codice UTI del corrispondente lifecycle event è quello che segue. La prima riga si riferisce alla chiusura della posizione originale mentre la seconda alla nuova posizione corretta:

Mic Code	Participant code	Trade date	Product ID	Trade number	Trade indicator	Chain indicator
000CGIT000	12345	20140107	ITC123456789	CSUBA2359591	B	C
000CGIT000	12345	20140107	ITC123456789	CSUBA2359592	S	C



---

## 8.0 Reporting delegato

Il trade repository scelto da CC&G per il reporting di transazioni è UnaVista. Borsa Italiana offre un servizio ai suoi clienti che include preparazione di report, consegna, validazione e, solo per contratti ETD, enrichment.

Per ulteriori informazioni si può far riferimento al team Clients Technology Service di Borsa Italiana:

Technical Account Management Italy

[clients-services@borsaitaliana.it](mailto:clients-services@borsaitaliana.it)

+39 02 72426348/606/647

Service Desk Italy

[service-desk@borsaitaliana.it](mailto:service-desk@borsaitaliana.it)

Toll Free: 0080026772000

From mobile: +39 02 45411399



---

© Maggio 2014 - Il presente documento è adottato a norma delle leggi speciali. Cassa di Compensazione e Garanzia S.p.A. non deve essere ritenuta responsabile per eventuali danni, derivanti anche da imprecisioni e/o errori, che possano derivare all'utente e/o a terzi dall'uso dei dati contenuti nel presente documento.

AGREX, BORSA ITALIANA, BORSA ITALIANA ITALIAN STOCK EXCHANGE, BORSA VIRTUALE, BORSAM@T, CITY FOR GOOD, DDM, ELITE, ETFplus, EUROMOT, EXPANDI, EXTRAMOT, IDEM-THE ITALIAN DERIVATIVES MARKET, IDEX, MIB, MIB 30, MIBTEL, MIDEX, MINIFIB, MIV, MOT, MTA, MTF, NIS, SEDEX, STAR, STAR SEGMENTO TITOLI CON ALTI REQUISITI, TECHSTAR nonché il marchio figurativo costituito da tre losanghe in obliquo sono marchi registrati di proprietà di Borsa Italiana S.p.A.

CC&G è un marchio registrato di proprietà di Cassa di Compensazione e Garanzia S.p.A.

MONTE TITOLI, X-TRM e MT-X sono marchi registrati di proprietà di Monte Titoli S.p.A.

MTS, BOND VISION, EUROMTS sono marchi registrati di proprietà di MTS S.p.A.

PALAZZO MEZZANOTTE CONGRESS CENTRE AND SERVICES, BEST VENUE INDICATOR, MARKET CONNECT sono marchi registrati di proprietà di Blt Market Services S.p.A.

London Stock Exchange ed il relativo logo, nonché AIM sono marchi registrati di proprietà di London Stock Exchange plc.

FTSE è un marchio registrato di proprietà del Gruppo London Stock Exchange ed è utilizzato da FTSE International Limited sotto licenza.

GATElab, Traderpath, Algorithmicpath, Exchangepath sono marchi registrati di proprietà di GateLab S.r.l.

I suddetti marchi registrati, nonché gli ulteriori marchi di proprietà del Gruppo London Stock Exchange, non possono essere utilizzati senza il preventivo consenso scritto della società del Gruppo proprietaria del marchio.

Il Gruppo promuove e offre i servizi Post Negoziazione prestati da Cassa di Compensazione e Garanzia S.p.A. e da Monte Titoli S.p.A., secondo modalità eque, trasparenti e non discriminatorie e sulla base di criteri e procedure che assicurano l'interoperabilità, la sicurezza e la parità di trattamento tra infrastrutture di mercato, a tutti i soggetti che ne facciano domanda e siano a ciò qualificati in base alle norme nazionali e comunitarie e alle regole vigenti nonché alle terminazioni delle competenti Autorità.

