

# Manuale Tecnico

Versione 2.5

MARZO 2024



**EURONEXT CLEARING**

# Indice

<b>1. PREMESSA</b> .....	<b>7</b>
<b>1.1 Parte I: Tabulati di clearing</b> .....	<b>7</b>
<b>1.2 Parte II: Dati in formato elaborabile</b> .....	<b>8</b>
<b>1.3 Parte III: Infrastruttura tecnologica</b> .....	<b>8</b>
<b>2. PARTE I TABULATI DI CLEARING</b> .....	<b>9</b>
<b>2.1 Sezione I: Operazioni</b> .....	<b>10</b>
2.1.1 RP-MT12 Contratti Conclusi Opzioni .....	10
2.1.2 RP-MT05 Posizioni nette per Contratti in Opzioni .....	11
2.1.3 RP-MT02 Opzioni Esercitate e/o Assegnate .....	13
2.1.4 RP-MT04 Trasferimenti non completati.....	15
2.1.5 RP-MT14 Opzioni Trasferite in Give-Up .....	18
2.1.6 RP-MT15 Opzioni Ricevute in Give-Up .....	19
2.1.7 RP-MT62 Contratti Conclusi Futures IDEM .....	20
2.1.8 RP-MT55 Posizioni Nette per Contratti Futures IDEM .....	21
2.1.9 RP-MT64 Futures Trasferiti in Give-Up .....	23
2.1.10 RP-MT65 Futures Ricevuti in Give-Up.....	24
2.1.11 RP-MT06 Contratti trasferiti mediante BCS .....	25
<b>2.2 Sezione II: Posizioni Contrattuali</b> .....	<b>27</b>
2.2.1 RP-MP01 Posizioni Aperte Opzioni nei conti.....	27
2.2.2 RP-MP02 Posizioni Aperte Opzioni nei sottoconti.....	28
2.2.3 RP-MS59 Operazioni sul capitale: posizioni in Opzioni rettificata.....	30
2.2.4 RP-MP11 Opzioni Scadute .....	31
2.2.5 RP-MP51 Posizioni Aperte Futures IDEM nei conti .....	32
2.2.6 RP-MP52 Posizioni Aperte Futures IDEM nei sottoconti .....	33
2.2.7 RP-MP31 Posizioni aperte obbligazioni .....	35
2.2.8 RP-MP21 Posizioni aperte obbligazioni .....	36
<b>2.3 Sezione III: Garanzie</b> .....	<b>37</b>
2.3.1 RP-MA01 Garanzie Collaterali Costituite .....	37
2.3.2 RP-MA03 Controvalore Garanzie Collaterali.....	39
2.3.3 RP-MI01 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri.....	42
2.3.4 RP-MI02 Controvalore Garanzie Collaterali infragiornaliere .....	43
<b>2.4 Sezione IV: Regolamento Margini e Default Fund</b> .....	<b>46</b>
2.4.1 RP-MS52 Avviso di Addebito/Accredito.....	46
2.4.2 RP-MS53 Pagamenti giornalieri per il Partecipante Diretto .....	48

2.4.3	RP-MS01 Sintesi Giornaliera .....	50
2.4.4	RP-MS11 Posizione Finanziaria .....	52
2.4.5	RP-MS12 Dettaglio Posizione Finanziaria .....	54
2.4.6	RP-MS61 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – posizioni marginabili .....	55
2.4.7	RP-MS62 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario - Mark-to-Market .....	56
2.4.8	RP-MS63 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – attribuzione classi .....	57
2.4.9	RP-MS64 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – abbattimento intra-classe.....	58
2.4.10	RP-MS65 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – abbattimento inter-classi.....	59
2.4.11	RP-MS67 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – margine finale .....	60
2.4.12	RP-MS70 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario ICSD .....	61
2.4.13	RP-MN13 Mappatura Margini Iniziali Paesi sovrani .....	62
2.4.14	RP-MN14 Margini Iniziali Paesi sovrani– Expected shortfall .....	63
2.4.15	RP-MS00 Riepilogo Margini Iniziali.....	64
2.4.16	RP-MI00 Riepilogo Margini Intraday.....	65
2.4.17	RP-MS33 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri .....	66
2.4.18	RP-MS31 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri .....	67
2.4.19	RP-MS32 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri .....	68
2.4.20	RP-MS35 Avviso di Addebito Margini Intraday .....	69
2.4.21	RP-MS36 Intraday - Importi GCM/NCM .....	71
2.4.22	RP-MS14 Default Fund: sintesi mensile .....	73
2.4.23	RP-MS15 Default Fund: dettaglio calcolo .....	74
2.4.24	RP-MMDF Variazione Default Fund Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	75
2.4.25	RP-MMMT Variazione Default Fund Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD .....	76
<b>2.5</b>	<b>Sezione V: Interessi e Commissioni .....</b>	<b>77</b>
2.5.1	RP-MS05 Interessi Mensili Maturati.....	77
2.5.2	RP-MF40 Commissioni giornaliere di rettifica .....	78
2.5.3	RP-MT36 Riepilogo Servizi Addebitati.....	80
2.5.4	RP-MT37 Elenco dei Servizi Sottoscritti .....	82
2.5.5	RP-MT48 Commissioni Mensili accumulate .....	83
2.5.6	RP-MT47 Commissioni Fail accumulate.....	85
2.5.7	RP-MFM4 Commissioni Obbligazionario Retail .....	86
2.5.8	RP-MFM6 Commissioni Obbligazionario Wholesale .....	87
2.5.9	RP-MFM8 ICSD - Retail Commissioni Mensili .....	88
2.5.10	RP-MFM9 ICSD - Commissioni Giornaliere .....	90
<b>2.6</b>	<b>Sezione VI: Scadenza Opzioni.....</b>	<b>91</b>
2.6.1	RP-MX01 Opzioni in scadenza .....	91
2.6.2	RP-MX04 Opzioni su Azioni Assegnate a Scadenza.....	93
<b>2.7</b>	<b>Sezione VII: Liquidazione Sottostanti dei Derivati.....</b>	<b>94</b>

2.7.1	RP-MD01 Opzioni Esercitate/Assegnate da liquidare .....	94
2.7.2	RP-MD51 Posizioni Futures in Consegna/Ritiro .....	95
2.7.3	RP-MD55 Titoli e controvalori in liquidazione sottostanti dei derivati azionari .....	96
<b>2.8</b>	<b>Sezione VIII: Fail, Buy-In e Sell-Out .....</b>	<b>97</b>
2.8.1	RP-ME30 Posizioni in fail marginabili - Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	97
2.8.2	RP-ME31 Posizioni in fail marginabili - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD .....	98
2.8.3	RP-MP10 Posizioni fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	100
2.8.4	RP-MP13 Posizioni fail - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD .....	101
2.8.5	RP-MP14 Posizioni in fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari.....	102
2.8.6	RP-MP15 Posizioni fail - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD .....	103
2.8.7	RP-MS97 Margini Posizioni Fail - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD .....	104
2.8.8	RP-MF13 Mappatura Margini iniziali posizioni Fail Paesi sovrani .....	105
2.8.9	RP-MF14 Margini iniziali posizioni Fail Paesi sovrani – Exp. short.....	106
2.8.10	RP-MF15 Totale Margini Fail .....	107
2.8.11	RP-MS90 Margini Iniziali Fail Comparto Obbligazionario ICSD .....	108
2.8.12	RP-MS91 Contratti selezionati.....	109
2.8.13	RP-MS92 Calculation of Initial Margins .....	110
2.8.14	RP-MS93 Calcolo dei margini Fail .....	111
2.8.15	RP-ME01 Buy-in Notice - Comparti Azionario e Derivati Azionari.....	112
2.8.16	RP-ME02 Buy-in Notice - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD .....	113
2.8.17	RP-ME03 Sell-Out Notice - Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	114
2.8.18	RP-ME04 Sell-Out Notice - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD .....	115
2.8.19	RP-ME05 Notifica di esecuzione di Buy-in - Comparti Azionario e Derivati Azionari.....	116
2.8.20	RP-ME06 Notifica di esecuzione di Buy-in - Comparto Obbligazionario.....	119
2.8.21	RP-ME07 Notifica di esecuzione di Sell-Out - Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	120
2.8.22	RP-ME08 Notifica di esecuzione di Sell-Out – Comparto Obbligazionario .....	121
2.8.23	RP-ME09 Esito Buy-In/partecipante in fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari.....	122
2.8.24	RP-ME10 Esito Buy-In/partecipante in bonis - Comparti Azionario e Derivati Azionari.....	124
2.8.25	RP-ME11 Esito Buy-In/partecipante in fail - Comparto Obbligazionario.....	125
2.8.26	RP-ME12 Esito Buy-In/partecipante in bonis-Comparto Obbligazionario.....	126
2.8.27	RP-ME13 Cash settlement/partecipante in fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	127
2.8.28	RP-ME14 Cash settlement/partecipante in bonis - Comparti Azionario e Derivati Azionari ....	129
2.8.29	RP-ME15 Cash settlement /partecipante in fail - Comparto Obbligazionario .....	131
2.8.30	RP-ME16 Cash settlement /partecipante in bonis - Comparto Obbligazionario .....	132
2.8.31	RP-ME17 Esito Sell-Out - Comparto Azionario e Derivati Azionari .....	133
2.8.32	RP-ME18 Esito Sell-Out - Comparto Obbligazionario .....	135
2.8.33	RP-ME20 Compensazione dei fails in esecuzione di Buy-In Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	136

2.8.34	RP-ME21 Compensazione dei fails in esecuzione di Buy-In – Comparto Obbligazionario.....	138
2.8.35	RP-ME25 Esecuzione Buy-In/Parzializzazione – Comparto Azionario e Derivati Azionari.....	139
2.8.36	RP-ME26 Esecuzione Buy-In/Parzializzazione - Comparto Obbligazionario .....	141
2.8.37	RP-ME40 Proroga Data Fine Validità Partecipante Diretto/Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	142
2.8.38	RP-ME41 Proroga Data Fine Validità Partecipante Diretto/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.....	143
2.8.39	RP-ME42 Proroga Data Fine Validità Partecipante Generale/Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	144
2.8.40	RP-ME43 Proroga Data Fine Validità Partecipante Generale/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.....	145
2.8.41	RP-ME44 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Diretto/Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	146
2.8.42	RP-ME45 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Diretto/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.....	147
2.8.43	RP-ME46 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Generale/Comparti Azionario e Derivati Azionari .....	149
2.8.44	RP-ME47 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Generale/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.....	150
2.8.45	RP-MD21 Parzializzazione e Splitting - Comparto obbligazionario ICSD .....	151
2.8.46	RP-MD22 parzializzazione - Comparto obbligazionario ICSD per Agente di Regolamento .....	153
<b>2.9</b>	<b>Sezione IX: Penali di Settlement.....</b>	<b>154</b>
2.9.1	RP-MS54 Penali – Importi Netti Mensili .....	154
2.9.2	RP-MS55 Penali – Importi Netti Mensili per Partecipante Diretto.....	155
<b>2.10</b>	<b>Sezione X: Basilea III – Asset Class .....</b>	<b>156</b>
2.10.1	RP-MB02 Equity Derivates asset class.....	156
2.10.2	RP-MB04 BOND asset class .....	157
<b>2.11</b>	<b>Sezione XI: Corporate Actions .....</b>	<b>158</b>
2.11.1	RP-MS18 Istruzioni di Contante – Comparto Obbligazionario ICSD .....	158
2.11.2	RP-MS21 Istruzioni di Contante S.A. – Comparto Obbligazionario ICSD.....	160
2.11.3	RP-MS38 Saldi Coupon Compensation – Comparto Obbligazionario ICSD .....	161
2.11.4	RP-MS40 Saldi Coupon Compensation S.A. – Comparto Obbligazionario ICSD.....	162
2.11.5	RP-MS39 Pagamenti Saldi Coupon Compensation – Comparto Obbligazionario ICSD.....	163
2.11.6	RP-MS41 Pagamenti Saldi Coupon Compensation S.A. – Comparto Obbligazionario ICSD ....	164
<b>2.12</b>	<b>Sezione XII: Estratti Conto Default Fund .....</b>	<b>165</b>
2.12.1	RP-MDF1 Estratto Conto – DF Equity – Bit e Derivati .....	165
2.12.2	RP-MDF2 Estratto Conto Scalare – DF Equity – Bit e Derivati .....	166
2.12.3	RP-MMT1 Estratto Conto – DF Bond – Obbligazion.MTS.....	167
2.12.4	RP-MMT2 Estratto Conto Scalare – DF Bond Obbligazion.MTS .....	168
<b>3.</b>	<b>PARTE II DATI IN FORMATO ELABORABILE .....</b>	<b>169</b>

<b>3.1 Sezione I: Server SFTP .....</b>	<b>169</b>
3.1.1 Dati Pubblici .....	169
3.1.2 Dati Privati .....	169
<b>3.2 Sezione II: Sistema di Negoziazione IDEM .....</b>	<b>171</b>
3.2.1 Dati Pubblici .....	171
3.2.2 Dati Privati .....	171
<b>3.3 Sezione III: Rendicontazione giornaliera dei pagamenti .....</b>	<b>172</b>
3.3.1 Messaggio M01 .....	173
3.3.2 Messaggio M03 .....	178
3.3.3 Messaggio MT298 .....	181
<b>4. PARTE III INFRASTRUTTURA TECNOLOGICA .....</b>	<b>183</b>
<b>4.1 Sezione I: BCS .....</b>	<b>183</b>
<b>4.2 Sezione II: ICWS .....</b>	<b>186</b>
<b>4.3 Sezione III: Dotazione tecnologica per Partecipante e Comparto .....</b>	<b>187</b>
<b>CONTATTI.....</b>	<b>188</b>

# 1. Premessa

Con il presente Manuale Tecnico si illustrano le informazioni ed i servizi che la Euronext Clearing fornisce ai Partecipanti e agli Agenti di Regolamento nonché i sistemi di veicolazione utilizzati.

Il Manuale Tecnico è suddiviso in parti e sezioni come si seguito indicato:

## 1.1 Parte I: Tabulati di clearing

Descrive i tabulati di *clearing* (definiti *Reports* nelle Istruzioni) che la Euronext Clearing provvede a inoltrare ai Partecipanti e agli Agenti di Regolamento. E' suddivisa in sezioni tematiche in relazione alle specifiche fasi del ciclo della compensazione e garanzia; le sezioni illustrano in dettaglio i contenuti dei tabulati di *clearing*. Sono anche descritti i sistemi per il tramite dei quali tali tabulati di *clearing* sono resi disponibili ai destinatari.

**Sezione I- Operazioni:** contratti negoziati e compensati;

**Sezione II - Posizioni Contrattuali:** posizioni nette contrattuali;

**Sezione III - Garanzie:** specie di strumenti finanziari (titoli di Stato e azioni) depositati a garanzia;

**Sezione IV - Regolamento Margini e Default Fund:** margini determinati da Euronext Clearing sulle posizioni contrattuali, situazione finanziaria, regolamento giornaliero;

**Sezione V - Interessi e Commissioni:** Interessi maturati e commissioni accumulate mensilmente;

**Sezione VI - Scadenza Opzioni:** posizioni contrattuali in opzioni esercitate e assegnate anticipatamente ed a scadenza;

**Sezione VII - Liquidazione sottostanti dei derivati:** posizioni contrattuali scadute, le cui attività sottostanti sono oggetto di regolamento presso il Servizio di liquidazione;

**Sezione VIII - Fail, Buy-in e Sell-out:** posizioni contrattuali in fail e procedure di buy-in e sell-out;

**Sezione IX: Penali di Settlement**

**Sezione X – Basilea III – Asset Classes:** Report relativi a Basilea III;

**Sezione XI – Corporate Actions:** Report relativi alle operazioni sul capitale;

**Sezione XII – Estratti Conto Default Fund:** Report relativi agli estratti conti dei Default Fund.

## **1.2 Parte II: Dati in formato elaborabile**

Illustra i dati e i servizi che Euronext Clearing rende disponibili in formato elaborabile ai Partecipanti e agli Agenti di Regolamento. E' suddivisa in Sezioni che illustrano in dettaglio i sistemi per il tramite dei quali i dati in formato elaborabile vengono veicolati ai Partecipanti.

**Sezione I – Server SFTP**

**Sezione II – Sistema di Negoziazione IDEM**

**Sezione III – Rendicontazione giornaliera dei pagamenti**

## **1.3 Parte III: Infrastruttura tecnologica**

Illustra l'Infrastruttura Tecnologica di Euronext Clearing e la dotazione necessaria per Partecipante e Comparto.

**Sezione I – BCS**

**Sezione II – ICWS**

**Sezione III – Dotazione tecnologica per Partecipante e Comparto**

## 2. Parte I Tabulati di clearing

I tabulati di *clearing* sono inoltrati ai Partecipanti e agli Agenti di Regolamento per il tramite dell'Infrastruttura Tecnologica (ICWS/BCS) e resi disponibili sul server SFTP ([ccgsftp.icws.it](https://ccgsftp.icws.it)), il cui accesso in entrambi i casi è consentito sottoscrivendo la Richiesta Servizi tramite il Member Portal ([memberportal.ccg.it](https://memberportal.ccg.it)).

I tabulati di clearing sono di norma disponibili al termine dell'elaborazione batch notturna.

Per la consultazione dei tabulati di clearing per il tramite dell'Infrastruttura Tecnologica consultare i Manuali ICWS e BCS disponibili sul sito di Euronext Clearing alla sezione [Operations>Manuali](#).

Per lo scarico dei tabulati di clearing dal server SFTP con procedure automatiche fare riferimento alle seguenti indicazioni:

Directory: contenente i reports WEBREPORT

**Nomi dei files:**

YYYYMMDD-XXXX-99999.pdf

YYYYMMDD-XXXX-99999-99999.pdf

YYYYMMDD: Data

XXXX: Nome del reports (es. MP21)

99999: Codice Ente del Partecipante Diretto (es. 09000)

99999: Codice Ente del Cliente Negoziatore (es. 09001)

## 2.1 Sezione I: Operazioni

Questa sezione descrive i tabulati relativi ai contratti negoziati e compensati, ai trasferimenti di posizioni/contratti, al giveup e agli esercizi/assegnazioni di opzioni.

### 2.1.1 RP-MT12 CONTRATTI CONCLUSI OPZIONI

Il tabulato elenca le opzioni negoziate dal Partecipante o ricevute in Give-Up Internazionale.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT12

Ader.:	GKK	Contratti Conclusi OPTIONS			RP-MT12	12 JAN 01 20:27:14	Pag.1
Valuta:	EURO	CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Contrattazioni Del: 12 JAN 01					
		Contratti conclusi dal Partecipante nella giornata :					
Contratto	Mese	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento	
	Consegna	Prezzo					
Conto:	TERZI *QMN						
SPG	O MAR01 2,50 C	0,1200	A	8	,80	116431	
	MAR01 2,50 C	0,1200	V	2	CCFF ,20	116556	

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "A" in caso di acquisto, con "V" in caso di vendita;
- i contratti ricevuti in Give-Up (presenti nel tabulato RP-MT15) sono corredati dall'indicazione del Partecipante negoziatore nella colonna "**Eseguiti Partecipante**";
- la colonna "**Commissioni di Clearing**" evidenzia, per ogni contratto, le relative commissioni dovute ad Euronext Clearing. Tali commissioni saranno addebitate al Partecipante il primo giorno lavorativo del mese successivo e riepilogate nel tabulato RP-MT48;
- il "**Numero di Riferimento**" indica il numero univoco identificativo del contratto.

## 2.1.2 RP-MT05 POSIZIONI NETTE PER CONTRATTI IN OPZIONI

Il tabulato indica l'importo da regolare con Euronext Clearing a titolo di premi e/o di margini di variazione giornalieri a fronte dell'attività in opzioni.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT05

Ader: GKK		Posizioni Nette Per Contratto OPTIONS					RP-MT05	24 JAN 01	20:11:33	Pag. 1	
Conto: TERZI *OMN		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA									
Contrattazioni del: 24 JAN 01											
Serie	Precedente Attivita'	Posiz. Corte	Aperte Lunghe	Mkt	O/C	Acquisti Vendite	Prezzo Prec/Contr	Prezzo di Chiusura	Margine di Variazione/Premio	Num. di Rif	
ENI JN01 6,80 P	TRANSFER	250+		I			0	0,4710	,00		
POSIZIONE NETTA ATTUALE		250									
G JA01 38 P	12JUC00	1	3				0,7380	0,3420	,00		
G JA01 38 P	POS CHG	1-		I				0,3420	,00		
G JA01 38 P	POS CHG		1-	I				0,3420	,00		
POSIZIONE NETTA ATTUALE			2								
MB FB01 11,50 C	9JUL05		3				0,1525	0,1320	,00		
MB FB01 11,50 C			1-		ESC			0,1320	,00		
MB FB01 11,50 C			2-	I	C	V	0,2200	0,1320	220,00 CR	108500	
POSIZIONE NETTA ATTUALE									220,00 CR		
MS FB01 11,50 P	3JUL05	1					0,1525	0,1210	,00		
MS FB01 11,50 P		1-		I	C	A	0,1100	0,1210	110,00 DR	108506	
POSIZIONE NETTA ATTUALE									110,00 DR		
SPMIB SP05 33000 P	18JUL05		2				333	377	,00		
SPMIB SP05 33000 P	TRF TRD		2-	I			520	377	2.600,00 CR	110612	
POSIZIONE NETTA ATTUALE									2.600,00 CR		
TIS JA01 15 C	10JAN01	4					2,3398	2,9866	,00		
TIS JA01 15 C		2-			ASG		2,9866		,00		
POSIZIONE NETTA ATTUALE		2									
TIT1 DC05 2,7746 C	15JUL05	1	9300				0,0786	0,0658	,00		
TIT1 DC05 2,7746 C	TRF POS		3924-	I			0,0000	0,0658	,00		
POSIZIONE NETTA ATTUALE		1	5376								
Totale Margini di Variazione							EU		,00		
Totale Premio							EU		2.710,00 CR		

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- le posizioni contrattuali trasferite vengono evidenziate con la dizione: "**TRANSFER**" se relative a trasferimento manuale; "**TRF POS**" se relative a trasferimenti effettuati con BCS;
- i contratti trasferiti mediante BCS, ad eccezione di quelli trasferiti in regime di give up Internazionale, vengono evidenziate con la dizione: "**TRF TRD**". Tali trasferimenti sono altresì riportati in un apposito report (MT06) contenente la lista di tutti i contratti trasferiti mediante BCS;
- I contratti presenti nel conto del partecipante rivenienti da contratti ricevuti mediante give up Internazionale sono riportati nel presente report senza indicazione di trasferimento. Detti trasferimenti sono comunque evidenziati nel Report MT06.
- le modifiche alle posizioni contrattuali lorde in conto terzi vengono evidenziate dalla dizione "**POS CHG**";
- gli esercizi e le assegnazioni vengono evidenziate rispettivamente dalle dizioni "**ESC**" e "**ASG**";
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "**A**" in caso di acquisto, con "**V**" in caso di vendita;
- l'importo del "**Totale Margini di Variazione**" e del "**Totale Premi**" viene riportato distintamente nei tabulati MS12 e MS11.

### 2.1.3 RP-MT02 OPZIONI ESERCITATE E/O ASSEGNATE

Il tabulato riporta l'elenco degli esercizi effettuati e delle assegnazioni subite dal Partecipante.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT02

Ader:GKK		Opzioni Esercitate e/o Assegnate		RP-MT02	19 JAN 01	20:44:40	Page	1
Valuta: EURO		EURONEXT CLEARING		Contrattazioni Del: 19 JAN 01				
				-----Valore Di Esercizio-----		Data di	Prezzo di	Tipo di
Serie	Conto	Esercitate	Assegnate	Debito	Credito	Liquid.	Liquid.	Liquid.
BTP JN01 102 C T *QMN		10		0		22 Jan 01	102,88	FUT
BIP JA01 7,20 C T *QMN			3	,00	21.600,00	24 JAN 01	7,20	ST
ENI JA01 7,20 P T *QMN			10	72.000,00	,00	24 JAN 01	7,20	ST
OIB30 JA01 45000 C T *QMN			7	3.780,00	,00	22 JAN 01	45216	CSH
OL JA01 3 P T *QMN			1	15.000,00	,00	24 JAN 01	3	ST
OL JA01 3,40 P T *QMN			3	51.000,00	,00	24 JAN 01	3,40	ST
SPG JA01 2 C T *QMN		1		5.000,00	,00	24 JAN 01	2	ST
				146.780,00	21.600,00			

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- nella colonna "**Conto**" è indicato il conto ("**P**" = Proprio, "**T**" = Terzi) e la relativa sezione (Omnibus o Sottoconto) in cui le posizioni in opzioni sono state esercitate o assegnate.
- nelle colonne "**Valore Di Esercizio**" - "**Debito**" o "**Credito**" - è indicato: per le opzioni che prevedono la liquidazione con "consegna" dell'attività sottostante, il controvalore da regolare in liquidazione; per le opzioni che prevedono il regolamento del differenziale per contante, l'importo da regolare. Gli importi sono ottenuti: per le opzioni su azioni, moltiplicando il numero di posizioni per il prezzo di liquidazione, per il numero di azioni sottostante il contratto di opzione; per le opzioni sull'indice, moltiplicando il numero di posizioni, per il valore del punto indice (moltiplicatore del contratto), per il differenziale tra prezzo di esercizio e il prezzo di liquidazione;
- nella colonna "**Data di Liquid.**" è indicato il giorno di regolamento in liquidazione dell'attività sottostante l'opzione;
- la colonna "**Prezzo di Liquid.**", nel caso di opzioni su azioni coincide con il prezzo di esercizio, nel caso di opzioni sull'indice, indica il valore dell'indice stesso calcolato sui primi prezzi di apertura degli strumenti finanziari che lo compongono, rilevati l'ultimo giorno di contrattazione.
- nella colonna "**Tipo di Liquid.**", la sigla "**ST**" indica che il regolamento avverrà presso il Servizio di Liquidazione, la sigla "**CSH**" indica che il regolamento avverrà per contante direttamente con Euronext Clearing;
- gli impegni che derivano, il giorno di liquidazione, dall'esercizio e/o dall'assegnazione delle opzioni che prevedono la liquidazione con "consegna" dell'attività sottostante sono riportati nel tabulato RP-MD01;

- l'importo complessivo del differenziale per contante da regolare con Euronext Clearing è riportato alla voce "Pagamento E/A" del tabulato RP-MS11. I Partecipanti Generali possono verificare le relative competenze, proprie e di ciascun Cliente Negoziatore, sul tabulato RP-MS12.

#### 2.1.4 RP-MT04 TRASFERIMENTI NON COMPLETATI

Il tabulato elenca tutti i trasferimenti di contratti e posizioni non completati nel corso della giornata di riferimento, suddivisi nelle due seguenti sezioni:

- Trasferimenti non completati, riproposti automaticamente il giorno successivo;
- Trasferimenti non completati, cancellati dal Sistema.

I **trasferimenti di contratto** e i **Give-Up Internazionali** non completati nella giornata saranno riproposti automaticamente da Euronext Clearing il giorno successivo e quindi indicati nella prima sezione del tabulato, nei seguenti casi:

- mancata gestione (accettazione o rifiuto) da parte del Partecipante ricevente;
- insufficienza di posizioni nel conto del Partecipante trasferente, rilevata al momento dell'accettazione della proposta di trasferimento da parte del Partecipante ricevente.

Gli stessi non saranno invece riproposti e saranno quindi indicati nella seconda sezione del tabulato nei seguenti casi:

- Raggiungimento del limite temporale consentito dal Regolamento (T+10);
- Rifiuto della proposta di trasferimento da parte del Partecipante ricevente;
- Cancellazione della proposta di trasferimento da parte del Partecipante trasferente;
- Cancellazione del contratto eseguita dal Mercato successivamente all'inserimento della proposta di trasferimento;
- Operazione sul capitale della Società emittente le azioni sottostanti il contratto.

La riproposizione di un Give-Up Internazionale non completato avverrà sotto forma di trasferimento di contratto T+1.

I trasferimenti di posizioni non completati non saranno riproposti in nessun caso. Gli stessi saranno quindi sempre cancellati a fine giornata e indicati nella seconda sezione del tabulato.

**ESEMPIO DI TABULATO RP-MT04**

Ader: XXXX/XXXXXXXXXX															
Trasferimenti non completati RP-MT04 7 MAY 21 21:36:04 Pag. 1															
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA															
Data richiesta: 7 MAY 21															
Trasferimenti non completati, riproposti automaticamente il giorno successivo:															
D/R	Act	Ora	Ret	O/C	Contr.	Data	Prezzo	Quantità	Sts	Cod.O/F	Descrizione	Cnt	ClientInfo	Cli.Acc	
D	C	09:16	N		024285	06/05/21	288,0000	1	H	0000	O	MIB01F25000	21557	CTR001	CL0001
D	C	10:17	N		034406	07/05/21	,7200	55	H	0000	O	UCG1L11	21555	TTR004	CL0004
D	C	11:22	N		044287	30/04/21	,6900	42	H	0000	O	3UCG1L11	21556	GTR008	CLXY08
D	C	15:45	N		054409	29/04/21	289,0000	5	H	0000	O	MIB01F25000	21555	TTR004	CL0002
R	C	16:03	N		064288	03/05/21	24.210,0000	2	I	0000	F	FIB1F	21557	CTR001	RHI987
R	C	17:25	N		074601	04/05/21	24.205,0000	8	I	0000	F	FIB1F	21556	GTR001	34ACBD
Trasferimenti non completati, cancellati dal Sistema:															
D/R	Act	Ora	Ret	O/C	Contr.	Data	Prezzo	Quantità	Sts	Cod.O/F	Descrizione	Cnt	ClientInfo	Cli.Acc	
D	C	09:11	N		014253	03/05/21	,1700	50	X	0000	O	ENI1G11	21555	S5RLD2	R10RDE
D	C	09:34	N		039407	06/05/21	,6907	15	C	0000	O	3UCG1L11	21557	FSW345	DDF8ER
D	C	10:13	N		056293	07/05/21	,7200	53	D	0000	O	UCG1L11	21557	445REW	GRT001
D	C	15:16	N		059402	28/04/21	287,0000	5	R	0000	O	MIB01F25000	21555	332FRE	GRT221
R	C	15:46	N		068437	29/04/21	,3700	60	X	0000	O	ENI1L11	21555	DESK01	CCFR09
D	C	16:12	N		068430	23/04/21	10,3266	78	T	0000	F	UCG1F	21556	ABC235	89FFI9
R	C	16:16	N		068431	23/04/21	,6900	4	T	0000	O	3UCG1L11	21556	TER334	34FRI3
R	C	17:47	N		072569	07/05/21	288,000	82	D	0000	O	MIB01F25000	21557	GIS890	33444F
R	C	18:17	N		082501	04/05/21	,7201	7	R	0000	O	UCG1L11	21557	GROUP2	TR0001
D	C	18:30	N				24.200,0000	3	R	0000	F	FIB1F	21556	TRTR01	RED004
R	C	22:25	N				24.200,0000	5	I	0000	F	FIB1F	21555	TY897H	PF0989
D	C	22:27	N				,0000	10	H	0000	O	MIB01F25000	21558	RT3324	GTK765

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**D/R**" indica se il trasferimento non completato era in uscita (D = deliver) o in entrata (R = receiver);
- La colonna "**Act**" indica il conto dal quale il trasferimento doveva essere effettuato;
- La colonna "**Contr.**" indica il numero del contratto non trasferito (il valore non è presente per i trasferimenti di posizioni);
- La colonna "**Data**" indica la data del contratto non trasferito (il valore non è presente per i trasferimenti di posizioni);
- la colonna "**Prezzo**" indica il prezzo di trasferimento del contratto o delle posizioni;
- La colonna "**Sts**" indica il motivo per cui il trasferimento non è stato completato, assumendo i seguenti valori:
  - "**H**", in caso di mancata gestione (accettazione o rifiuto) da parte del Partecipante ricevente;
  - "**I**", in caso di insufficienza di posizioni nel conto del Partecipante trasferente, rilevata al momento dell'accettazione della proposta di trasferimento da parte del Partecipante ricevente;
  - "**T**", in caso di raggiungimento del limite temporale (T+10) consentito dal Regolamento per i trasferimenti di contratto;
  - "**R**", in caso di rifiuto della proposta di trasferimento da parte del Partecipante ricevente;
  - "**C**", in caso di cancellazione della proposta di trasferimento da parte del Partecipante trasferente prima che la stessa sia stata gestita (accettata o rifiutata) dal Partecipante ricevente;

- “**D**”, in caso di cancellazione del contratto da parte del Mercato, successivamente all’inserimento della proposta di trasferimento;
- “**X**”, in caso di operazione sul capitale della Società emittente le azioni sottostanti il contratto (escluse quelle relative alla distribuzione di dividendi e agli aumenti di capitale);
- La colonna “**O/F**” indica se il contratto è un’opzione (O) o un futures (F);
- la colonna “**Cnt**” indica il Codice ENTE del Partecipante controparte;
- la colonna “**Client Info**” può contenere le informazioni relative al cliente;
- la colonna “**Cli. Acc.**” Può contenere il Codice Cliente.

## 2.1.5 RP-MT14 OPZIONI TRASFERITE IN GIVE-UP

Il tabulato elenca le opzioni negoziate in regime di *Give-Up* e trasferite a altro Partecipante.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT14

Ader.: GKK		Opzioni Trasferite in Give-Up		RP-MT14	18 JAN 01	21:29:48	Pag. 1		
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		Contrattazioni Del: 18 JAN 01					
Contratti conclusi dal Partecipante nella giornata :									
Contratto	Mese	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Partecipante di Clearing	Numero di Riferimento			
Consegna									
Conto : TERZI *OMN									
ENI	O	MAR01	6,40	P	0,1780	A	600	YYYY	104959
		MAR01	6,40	P	0,1780	V	600	YYYY	104959
		MAR01	6,40	P	0,1785	A	400	YYYY	104962
		MAR01	6,40	P	0,1785	V	400	XXXX	104962
SEMIB	O	JAN01	45500	C	30	A	10	XXXX	113819
		JAN01	45500	C	34	A	5	YYYY	114169
		JAN01	45500	C	34	A	1	YYYY	114228
		JAN01	45500	C	34	A	1	YYYY	114232
		JAN01	45500	C	34	A	1	YYYY	114291
		JAN01	45500	C	35	A	2	YYYY	114322
		JAN01	45500	C	30	A	10	YYYY	114454
		JAN01	45500	C	33	A	100	YYYY	114512

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "A" in caso di acquisto, con "V" in caso di vendita;
- i contratti trasferiti in Give-Up sono corredati dall'indicazione del Partecipante che li ha ricevuti nella colonna "Partecipante di Clearing";
- il "**Numero di Riferimento**" indica il numero univoco identificativo del contratto.

## 2.1.6 RP-MT15 OPZIONI RICEVUTE IN GIVE-UP

Il tabulato elenca le opzioni negoziate da altro Partecipante e ricevute in *Give-Up*.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT15

Ader.: GKK		Opzioni Ricevute in Give-Up		RP-MT15	18 JAN 01	21:30:05	Pag.	1	
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		Contrattazioni Del: 18 JAN 01					
Contratti conclusi dal Partecipante nella giornata :									
Contratto	Mese	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento		
Consegna									
Conto : TERZI *QMN									
ENI	O MAR01	6,40	P	0,1780	A	600	YYYY	60,00	104959
	MAR01	6,40	P	0,1780	V	600	YYYY	60,00	104959
	MAR01	6,40	P	0,1785	A	400	YXX	40,00	104962
	MAR01	6,40	P	0,1785	V	400	YXX	40,00	104962
OIB30	O JAN01	45500	C	30	A	10	YYCC	4,10	113819
	JAN01	45500	C	34	A	5	YYCC	2,05	114169
	JAN01	45500	C	34	A	1	WRR	,41	114228
	JAN01	45500	C	34	A	1	WRR	,41	114232
	JAN01	45500	C	34	A	1	WRR	,41	114291
	JAN01	45500	C	35	A	2	WRR	,82	114322
	JAN01	45500	C	30	A	10	WRR	4,10	114454
	JAN01	45500	C	33	A	100	WRR	41,00	114512

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "A" in caso di acquisto, con "V" in caso di vendita;
- la colonna "**Eseguiti Partecipante**" indica il Partecipante che ha eseguito i contratti ricevuti in Give-Up;
- la colonna "**Commissioni di Clearing**" evidenzia, per ogni contratto, le relative commissioni dovute a Euronext Clearing. Tali commissioni saranno addebitate al Partecipante il primo giorno lavorativo del mese successivo e riepilogate nel tabulato RP-MT48;
- il "**Numero di Riferimento**" indica il numero univoco identificativo del contratto.

## 2.1.7 RP-MT62 CONTRATTI CONCLUSI FUTURES IDEM

Il tabulato elenca i contratti futures negoziati sul mercato IDEM dal Partecipante o ricevuti in *Give-up*.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT62

Ader.: GKK		Contratti Conclusi FUTURES IDEM			RP-MT62	4 JAN 01	20:33:27 Pag. 1
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Contrattazioni Del: 4 JAN 01					
		Contratti conclusi dal Partecipante nella giornata :					
Contratto	Mese	Acquisto/ Prezzo	Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento
Consegna							
Conto : TERZI *OMN							
MIB30 F	MAR01	43450	V	2		,52	100010
	MAR01	43410	A	1		,26	100073
	MAR01	43040	V	1	YYYY	,26	105727
	MAR01	43040	V	1		,26	105731
	MAR01	42800	A	1		,26	108781
	MAR01	42800	A	1	XXXX	,26	108782
	MAR01	42700	A	2	YYYY	,52	113880

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "**A**" in caso di acquisto, con "**V**" in caso di vendita;
- i contratti ricevuti in Give-Up, evidenziati nell'apposito tabulato RP-MT65, sono corredati dall'indicazione del Partecipante negoziatore nella colonna "**Eseguiti Partecipante**";
- il "**Numero di Riferimento**" indica il numero univoco identificativo del contratto.

## 2.1.8 RP-MT55 POSIZIONI NETTE PER CONTRATTI FUTURES IDEM

Il tabulato indica l'importo da regolare a titolo di Margini di variazione giornalieri a fronte dell'attività in *futures*.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT55

Ader: GKK		Posizioni Nette Per Contratto FUTURES IDEM				RP-MT55	1 JUL 05	21:03:09	Pag. 1	
AAA		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
Conto:PROPRIO *QVN		Contrattazioni del: 1 JUL 05								
Precedente	Posiz. Aperte	Acquisti	Prezzo	Prezzo di	Margine	Num.				
Serie	Attivita'	Corte	Lunghe	Mkt O/C	Vendite Prec/Contr	Chiusura	di Variazione	di Rif		
MINI SP05	29JUN05		5			32341	32420		395,00	CR
POSIZIONE NETTA ATTUALE			5						395,00	CR
SEMIB SP05	29JUN05	27				32341	32420		10.665,00	DR
SEMIB SP05		2+	I	O	S	32325	32595		2.700,00	DR 109034
SEMIB SP05			2+	I	O	B	32615	32595	200,00	DR 109812
SEMIB SP05	TRANSFER	3-		I		32420	32595		2.625,00	CR
SEMIB SP05	TRF TRD		1+	I		32330	32595		1.325,00	CR 109934
SEMIB SP05	TRF POS	1+		I		32420	32595		875,00	DR
POSIZIONE NETTA ATTUALE			24						10.490,00	DR
							Totale Margini di Variazione	EU	10.095,00	DR

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- le posizioni contrattuali trasferite vengono evidenziate con la dizione: "**TRANSFER**" se relative a trasferimento manuale; "**TRF POS**" se relative a trasferimenti effettuati con BCS;
- i contratti trasferiti mediante BCS, ad eccezione di quelli trasferiti in regime di give up Internazionale sono evidenziate con la dizione: "**TRF TRD**". Tali trasferimenti sono altresì riportati in un apposito report (MT06) contenente la lista di tutti i contratti trasferiti mediante BCS;
- I contratti ricevuti in regime di give-up sono riportati senza indicazione di trasferimento. Detti trasferimenti sono comunque evidenziate nei reports: MT14, MT15, MT64, MT65 e MT06.
- eventuali segnalazioni "**POS CHG**" sono da intendersi come interventi di Euronext Clearing effettuati al fine di trasferire posizioni futures non presenti sul sistema di clearing in quanto tenute al netto;
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "**A**" in caso di acquisto, con "**V**" in caso di vendita;
- la colonna "**Prezzo Prec/Contr**" indica, per le posizioni contrattuali in essere all'inizio della giornata di riferimento, il prezzo di chiusura precedente; per i contratti negoziati nel giorno, i prezzi degli stessi;

- l'ultimo giorno di negoziazione del contratto, nella colonna "**Prezzo di Chiusura**" è riportato il Prezzo di Regolamento alla Scadenza (prezzo, definito dalla Società di Gestione del Mercato nello Schema Contrattuale, occorrente per l'esecuzione differenziale del contratto) e nella colonna "Margine di Variazione" il Margine di variazione finale;
- l'importo del "**Totale Margini di Variazione**" viene riportato nei tabulati RP-MS12 e RP-MS11;
- il "**Numero di Riferimento**" indica il numero univoco identificativo del contratto.

## 2.1.9 RP-MT64 FUTURES TRASFERITI IN GIVE-UP

Il tabulato elenca i contratti futures negoziati e trasferiti in regime di *Give-Up* ad altro Partecipante.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT64

Ader.:	GKK	Futures Trasferiti in Give-Up RP-MT64			16 JAN 01 20:58:34	Pag.1
Valuta:	EURO	CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				
		Contrattazioni Del: 16 JAN 01				
		Contratti conclusi dal Partecipante nella giornata :				
Contratto	Mese	Acquisto/ Prezzo	Vendita	Contratti Negoziati	Partecipante di Clearing	Numero di Riferimento
	Consegna					
Conto : TERZI *QMN						
MIB30 F	MAR01	44480	V	5	TTCC	100187
	MAR01	44080	V	1	TTCC	107670
	MAR01	44080	V	1	TTCC	107671
	MAR01	44145	V	1	YYYY	108719
	MAR01	44145	V	1	YYYY	108720
	MAR01	44170	V	3	TTCC	110449

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ai comparti Derivati ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "**A**" in caso di acquisto, con "**V**" in caso di vendita;
- i contratti sono corredati dall'indicazione del Partecipante che li ha ricevuti in Give-Up nella colonna "**Partecipante di Clearing**" ed evidenziati nel report RP-MT62 del Partecipante Designato;
- il "Numero di Riferimento" indica il numero univoco identificativo del contratto.

## 2.1.10 RP-MT65 FUTURES RICEVUTI IN GIVE-UP

Il tabulato elenca i contratti futures negoziati da un altro Partecipante e trasferiti in *Give-Up* al Partecipante.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT65

Ader.: GKK		Futures Ricevuti in Give-Up			RP-MT65	16 JAN 01	20:58:57 Pag.	1
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
		Contrattazioni Del: 16 JAN 01						
		Contratti conclusi dal Partecipante nella giornata :						
Contratto	Mese	Acquisto/ Prezzo	Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento	
Conto : TERZI *QMN								
MIB30 F	MAR01	44480	V	5	TTCC	1,30	100187	
	MAR01	44450	A	1	YYCC	,26	100522	
	JUN01	44320	V	1	TTCC	,26	100523	
	MAR01	44440	A	1	TTCC	,26	100593	
	JUN01	44310	V	1	YYCC	,26	100598	
	MAR01	44335	A	1	TTCC	,26	101353	
	JUN01	44205	V	1	TTCC	,26	101354	
	MAR01	44080	V	1	XXCC	,26	107670	
	MAR01	44080	V	1	TTCC	,26	107671	
	MAR01	44145	V	1	TTCC	,26	108719	
	MAR01	44145	V	1	TTCC	,26	108720	
	MAR01	44095	V	2	TTCC	,52	115082	

- Il tabulato viene prodotto per i Partecipanti ai comparti Derivati ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- i contratti sono corredati dall'indicazione del Partecipante che li ha negoziati nella colonna "Eseguiti Partecipante" (cfr. RP-MT62);
- la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "**A**" in caso di acquisto, con "**V**" in caso di vendita;
- il "**Numero di Riferimento**" indica il numero univoco identificativo del contratto.

## 2.1.11 RP-MT06 CONTRATTI TRASFERITI MEDIANTE BCS

Il tabulato indica la lista dei trasferimenti, compreso il *Give-up* internazionale, effettuati mediante la BCS.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT06

Ader: GKK		Trasferimento Contratti							RP-MT06	28 JUL 05	20:54:35	Pag.					
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA																	
Data richiesta: 28 JUL 05																	
D/R	Act	Ora	Ret	O/C	Contr.	Data	Prezzo	Quantità	Sts	Cod.	O/F	Descrizione	Cnt.	Client	Info	Cli.	Acc
D	C	11:38	Y		111260	27/07/05	33.740,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	22097				AKDESK
D	C	11:40	Y		111308	27/07/05	33.740,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	22605				AKDESK
D	C	11:42	Y		111289	27/07/05	33.740,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03069				AKDESK
D	C	11:42	Y		111252	27/07/05	33.745,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03069	1AANLP			AKDESK
D	C	11:43	N		100245	27/07/05	33.745,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03015				AKDESK
R	C	12:18		O	109313	27/07/05	33.775,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03131				U35F
R	C	12:18		O	109314	27/07/05	33.775,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03131				U35F
R	C	13:57		O	106499	26/07/05	33.690,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03249	1AANLP			IT
D	C	17:02	Y		121131	21/07/05	,9495	25	P	0000	O	ENI DC05	23 C 03104	LTOPDE			LTOPDE

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ai comparti Derivati ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- nella colonna "**D/R**", "**D**" indica i contratti ceduti ad altri partecipanti; "**R**" i contratti ricevuti da altri partecipanti;
- la colonna "**Act**" è valorizzata con "**C**" se il trasferimento riguarda il conto terzi, con "**H**" se riguarda il conto "proprio";
- La colonna "**Ora**" indica l'ora in cui il trasferimento ha avuto luogo;
- la colonna "**Ret**" è valorizzata con "**Y**" o "**N**" se, ai fini del trasferimento, il Partecipante ha chiesto o meno la rettifica delle posizioni in essere. Il campo non è valorizzato per i contratti ricevuti;
- la colonna "**O/C**" è valorizzata con "**C**" se il Partecipante, nell'accettare il trasferimento, ha indicato che le posizioni ricevute debbono andare a chiudere posizioni preesistenti; con "**O**" se le posizioni ricevute non devono chiudere posizioni preesistenti;
- La colonna "**Contr.**", unitamente alla data, individua in modo univoco il contratto trasferito, indicando il giorno in cui tale contratto è stato stipulato sul mercato ed il relativo numero di riferimento;
- La colonna "**Prezzo**" indica il prezzo di trasferimento;
- La colonna "**O/F**" è valorizzata con "**O**" se il trasferimento si riferisce ad opzioni; con "**F**" se riguarda futures;

- Nella colonna “**Cnt.**” viene indicato il codice Euronext Clearing del Partecipante controparte del trasferimento.

## 2.2 Sezione II: Posizioni Contrattuali

Questa sezione descrive i tabulati delle posizioni aperte.

### 2.2.1 RP-MP01 POSIZIONI APERTE OPZIONI NEI CONTI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni contrattuali aperte in opzioni in ciascun conto. Il dettaglio delle posizioni in opzioni aperte nei sottoconti è fornito nel tabulato MP02.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP01

Codice				Contratto		Precedente		-----Terzi-----		-----Proprio-----	
ISIN				Attività'	Lunghe	Corte	Lunghe	Corte			
IT0008161546	MS	FB01	14,50 C	19 JAN 01	5	1		2			
IT0008280403	MS	FB01	15,00 C	18 JAN 01		2					
IT0008317494	MS	FB01	13,00 P	18 JAN 01	4	4	8				
IT0008161611	MS	FB01	15,00 P	18 JAN 01	6			4			
IT0008161579	MS	FB01	15,50 P	18 JAN 01				3			
CALLS					5	3		2			
PUTS					10	4	8	7			
IT0008220284	OL	MR01	5 C	16 NOV 00	5						
CALLS					5						
IT0008170737	TIM	FB01	9 C	19 JAN 01		5					
CALLS						5					

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Contratto**" indica le caratteristiche del contratto di opzione, incluso il prezzo di esercizio e il tipo di diritto (C = call; P = put);
- la colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data nella quale la posizione contrattuale è stata movimentata;
- le colonne relative ai conti "**Terzi**" e "**Proprio**" indicano le posizioni contrattuali lorde lunghe e/o corte;
- il tabulato non indica le posizioni contrattuali in opzioni Esercitate/Assegnate, che sono invece evidenziate nel tabulato MT02 e le posizioni scadute che sono riportate nel report MP11.

## 2.2.2 RP-MP02 POSIZIONI APERTE OPZIONI NEI SOTTOCONTI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni contrattuali in opzioni registrate nei conti e nei relativi sottoconti.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP02

Ader: GKK		Sub-Account Options Open Positions			RP-MP02	15 JAN 08	17:40	Pag. 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
Posizioni Iniziali al: 15 JAN 08								
Acct: TERZI *OMN								
Codice	Contratto		Precedente	-----	Posizioni	-----		
Isin			Attivita'		Lunghe		Corte	
IT0008865823	ENEL MR08 8,40 C		7 JAN 08		10		2.230	
IT0008722495	ENEL JN08 7,60 P		13 DEC 07		3		15	
CALLS					10		2.230	
PUTS					3		15	
Acct: TERZI SUBI								
Codice	Contratto		Precedente	-----	Posizioni	-----		
Isin			Attivita'		Lunghe		Corte	
IT0008884857	SPMIB DC08 54000 C		30 OCT 07				18	
IT0008622430	SPMIB JN09 25000 P		7 JAN 08		16		250	
IT0008622414	SPMIB JN09 26000 P		6 DEC 07				2	
CALLS							18	
PUTS					16		252	
Acct: PROPRIO *OMN								
Codice	Contratto		Precedente	-----	Posizioni	-----		
Isin			Attivita'		Lunghe		Corte	
IT0008944818	ENC JN08 25 C		3 DEC 07				130	
CALLS							130	

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- alla voce "**Acct:**" è indicato il conto (PROPRIO o TERZI) e la relativa sezione (\*OMN o sottoconto) dove sono registrate le posizioni;
- la colonna "**Contratto**" indica le caratteristiche del contratto di opzione, incluso il prezzo di esercizio e il tipo di diritto (C = call; P = put);
- la colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data nella quale la posizione contrattuale è stata movimentata;

- le colonne "**Lunghe**" e "**Corte**" indicano il numero di posizioni lunghe e corte aperte in ciascuna serie di opzioni;
- le voci "**CALLS**" e "**PUTS**" indicano il numero di posizioni di tipo "call" e "put", lunghe e corte, aperte per ciascun contratto.
- il tabulato non indica le posizioni contrattuali in opzioni Esercitate/Assegnate, che sono invece evidenziate nel tabulato MT02 e le posizioni scadute che sono riportate nel report MP11.

## 2.2.3 RP-MS59 OPERAZIONI SUL CAPITALE: POSIZIONI IN OPZIONI RETTIFICATE

Il tabulato riporta, per lo opzioni oggetto di rettifica, le posizioni contrattuali aperte prima e dopo la rettifica.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS59

Ader: GKK		Posizioni Iso-a Aggiustate			RP-MS59	15 JUL 05	21:12:57	Pag.
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
Contrattazioni del: 15 JUL 05								
Conto: TERZI								
	Old Series	Old Long	Old Short		New Series	New Long	New Short	
FNC SP05	,68 P	0	2	FNC1 SP05	13,60 P	0	2	
FNC SP05	,70 C	0	1	FNC1 SP05	14 C	0	1	
FNC DC05	,68 P	0	2	FNC1 DC05	13,60 P	0	2	

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile la mattina in cui ha effetto la rettifica, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Old series**" indica la serie prima della rettifica;
- le colonne "**Old Long**" e "**Old Short**" indicano rispettivamente il numero delle posizioni lunghe e corte aperte prima della rettifica;
- la colonna "**New series**" indica la serie dopo la rettifica;
- le colonne "**Old Long**" e "**Old Short**" indicano rispettivamente il numero delle posizioni lunghe e corte aperte dopo la rettifica.

## 2.2.4 RP-MP11 OPZIONI SCADUTE

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni contrattuali scadute in opzioni.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP11

Ader: : GKK		Opzioni Scadute			RP-MP11	19 JAN 01	21:09:26	Pag. 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
Posizioni Iniziali al: 22 JAN 01								
Codice	Contratto			Precedente	-----Terzi-----	-----Proprio-----		
ISIN				Attivita'	Lunghe	Corte	Lunghe	Corte
IT0008295377	TIM	JA01	9 C	8 JAN 01		5		
CALLS						5		

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile il giorno successivo a quello di scadenza, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Contratto**" indica le caratteristiche del contratto di opzione, incluso il prezzo di esercizio e il tipo di diritto (C = call; P = put);
- la colonna relativa al conto "**Terzi**" indica le posizioni contrattuali lorde lunghe e corte, nella colonna relativa al conto "**Proprio**" sono indicate le posizioni contrattuali nette lunghe e corte;
- le colonne "**Terzi**" e "**Proprio**" - "**Lunghe**" e "**Corte**" - indicano le posizioni contrattuali in opzioni scadute ossia che non sono state oggetto di Esercizio/Assegnazione a scadenza.

## 2.2.5 RP-MP51 POSIZIONI APERTE FUTURES IDEM NEI CONTI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni aperte *futures* IDEM in ciascun conto. Il dettaglio delle posizioni *futures* IDEM aperte nei sottoconti è fornito nel tabulato MP52

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP51

Ader: : GKK		Posizioni Aperte FUTURES IDEM nei conti				RP-MP51	3 JAN 01	21:06:39	Pag. 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA									
Posizioni Nette Iniziali al: 4 JAN 01									
Codice	Contratto	Precedente	-----Terzi-----			-----Proprio-----			
ISIN		Attivita'	Lunghe	Corte	Lunghe	Corte			
IT0008280890	MIB30 MR01	3 JAN 01	55				6		
MIB30			55				6		
IT0008165059	MM30 MR01	3 JAN 01	24		3				
MM30			24		3				

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Contratto**" indica le caratteristiche del contratto *futures*;
- la colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data nella quale la posizione contrattuale è stata movimentata;
- le colonne relative al conto "**Terzi**" e al conto "**Proprio**" indicano le sole posizioni contrattuali nette;
- il tabulato non indica le posizioni contrattuali *futures* scadute.

## 2.2.6 RP-MP52 POSIZIONI APERTE FUTURES IDEM NEI SOTTOCONTI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni *futures* IDEM registrate nei conti e nei relativi sottoconti.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP52

Ader: GKK		Posizioni Aperte FUTURES IDEM nei Sottoconti			RP-MP52	15 JAN 08	17:42	Pag. 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
Posizioni Nette Iniziali al: 15 JAN 08								
Acct: TERZI		*OMN						
Codice	Contratto	Precedente	-----	Posizioni	-----			
Isin		Attivita'		Lunghe		Corte		
IT0009047215	ENI JA08	3 JAN 08		6				
IT0008865575	ENI MR08	21 DEC 07				4		
	ENI			6		4		
Acct: TERZI		SUB1						
Codice	Contratto	Precedente	-----	Posizioni	-----			
Isin		Attivita'		Lunghe		Corte		
IT0008856756	SPMIB MR08	14 JAN 08				47		
IT0008937226	SPMIB JN08	10 JAN 08				2		
	SPMIB					49		
Acct: PROPRIO		*OMN						
Codice	Contratto	Precedente	-----	Posizioni	-----			
Isin		Attivita'		Lunghe		Corte		
IT0008856756	SPMIB MR08	14 JAN 08		7				
IT0008937226	SPMIB JN08	10 JAN 08				3		
	SPMIB			7		3		

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- alla voce "**Acct:**" è indicato il conto (PROPRIO o TERZI) e la relativa sezione (\*OMN o sottoconto) dove sono registrate le posizioni;
- la colonna "**Contratto**" indica le caratteristiche del contratto *futures*;
- la colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data nella quale la posizione contrattuale è stata movimentata;
- le colonne "**Lunghe**" e "**Corte**" indicano il numero di posizioni nette, lunghe o corte, aperte per il contratto;

- il tabulato non indica le posizioni contrattuali *futures* scadute.

## 2.2.7 RP-MP31 POSIZIONI APERTE OBBLIGAZIONI

Il tabulato riporta l'elenco di tutte le obbligazioni in essere con indicazione della quantità e del controvalore.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP31

Ader: GKK		Posizioni Comparto Obbligazionario					MP31	19 DEC 02	17:23:35
EUR		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					Posizioni Nette Iniziali al: 20 DEC 02		
Titolo	Codice	Data	Data	Ty Ac L/	Quantita	Controvalore	Controvalore		
	Isin	Liquid	Contrat	pe ct C			Rateo		
BTP 15/01/03 4.50%	IT0001423844	20 DEC 02	17 DEC 02	P C	15.000.000	13.485.000,00CR	289.810,50CR		
BTP 15/12/05 5,25%	IT0001488102	20 DEC 02	4 DEC 02	T P C	100.000.000	101.939.839,51CR	72.120,00CR		
CTZ 02-31/12/03 24M	IT0003217830	20 DEC 02	17 DEC 02	P L	15.000.000	11.698.500,00			
Saldo del: 20 DEC 02 Conto	PROPRIO	104.088.270,01CR							
CCT 01/01/97-04	IT0000367885	06 JAN 03	4 DEC 02	T P L	300.000.000	285.615.474,33	199.560,00		
Saldo del: 06 JAN 03 Conto	PROPRIO	285.815.034,33							
CCT 01/01/97-04	IT0000367885	10 JAN 03	6 DEC 02	T P		8.461,67CR			
Saldo del: 10 JAN 03 Conto	PROPRIO	8.461,67CR							
BTP 01/01/04 8,50%	IT0000366762	15 JAN 03	12 DEC 02	T P C	100.000.000	105.558.680,64CR	328.730,00CR		
CCT 01/01/97-04	IT0000367885	15 JAN 03	12 DEC 02	T P C	100.000.000	100.422.855,59CR	186.250,00CR		
CCT 01/03/97-04	IT0001101234	15 JAN 03	12 DEC 02	T P		488.897,74CR			
Saldo del: 15 JAN 03 Conto	PROPRIO	206.985.413,97CR							
BTP 01/01/04 8,50%	IT0000366762	16 JAN 03	12 DEC 02	T P C	600.000.000	633.481.675,86CR	2.113.260,00CR		
CCT 01/01/97-04	IT0000367885	16 JAN 03	12 DEC 02	T P C	500.000.000	502.583.387,75CR	997.750,00CR		
Saldo del: 16 JAN 03 Conto	PROPRIO	1.139.176.073,61CR							

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni. Le posizioni aperte sono suddivise per valuta di liquidazione ed è prodotta una pagina per ogni singola valuta. Il saldo è calcolato come somma delle posizioni con la stessa valuta e la stessa data di liquidazione.
- la colonna "**Type**" contiene i valori P o T per le "gambe" rispettivamente a pronti e termine di un contratto Repo; non è popolato per contratti "cash";
- la colonna "**Acct**" indica il conto (T=Terzi;P=proprio);
- la colonna "**L/C**" indica se la posizione è lunga o corta;
- Il Controvalore indicato è comprensivo del "**Controvalore Rateo**" di cui alla colonna successiva.

## 2.2.8 RP-MP21 POSIZIONI APERTE OBBLIGAZIONI

Il tabulato riporta l'elenco di tutte le azioni in essere con indicazione della quantità e del controvalore.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP21

Ader: GKK				Posizioni Comparto Azionario			RP-MP21	17 JUL 02	12:40:13	Pag. 1
				CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
				Posizioni Nette Iniziali al: 18 JUL 02						
Simbolo	Data	Data	Cto	Posizioni	Prezzo	Controvalore	Credito/Debito			
	Liquidaz.	Negoziat.	L/C	Quantit..	Riferimento	Corrente	Teorico			
AL	18 JUL 02	15 JUL 02	T L	9.124	8,197000	74.999,28	209,86			
BMPS	18 JUL 02	15 JUL 02	T L	4.300	3,105000	13.026,00	325,50CR			
FNC	18 JUL 02	15 JUL 02	T L	35.000	,757100	24.920,00	1.578,50CR			
OL	18 JUL 02	15 JUL 02	T L	35.056	1,135000	36.027,23	3.761,33CR			
SPG	18 JUL 02	15 JUL 02	T L	18.645	,687500	12.119,25	699,18CR			
TIM	18 JUL 02	15 JUL 02	T L	58.124	4,498000	247.027,00	14.414,75CR			
UC	18 JUL 02	15 JUL 02	T L	27.944	4,058000	110.658,24	2.738,51CR			
Saldo liquidazione del:	18 JUL 02			Conto TERZI		518.777,00				
BFI	19 JUL 02	16 JUL 02	T L	2.500	5,290000	12.325,00	900,00CR			
ENEL	19 JUL 02	16 JUL 02	T C	500	5,039000	2.575,00CR	55,50CR			
ENI	19 JUL 02	16 JUL 02	T C	73	14,406000	1.043,90CR	7,73			
G	19 JUL 02	16 JUL 02	T C	1.497	20,590000	30.077,59CR	745,64			
MED	19 JUL 02	16 JUL 02	T L	3.335	5,721000	17.342,00	1.737,53CR			
OL	19 JUL 02	16 JUL 02	T C	18.761	1,135000	19.616,91CR	1.676,82			
SPI	19 JUL 02	16 JUL 02	T C	703	8,136000	5.413,10CR	306,50			
SPM	19 JUL 02	16 JUL 02	T L	750	6,746000	4.875,00	184,50CR			
TI	19 JUL 02	16 JUL 02	T C	1.020	8,201000	7.650,00CR	715,02			
UC	19 JUL 02	16 JUL 02	T C	1.000	4,058000	4.010,00CR	48,00			
UNI	19 JUL 02	16 JUL 02	T L	310	4,064000	1.261,70	1,86			
Saldo liquidazione del:	19 JUL 02			Conto TERZI		34.582,80CR				
BMPS	22 JUL 02	17 JUL 02	T C	123	3,105000	382,53CR	,62CR			
FDL	22 JUL 02	17 JUL 02	T C	1.000	11,779000	11.780,00CR	1,00CR			
OL	22 JUL 02	17 JUL 02	T C	19.060	1,135000	21.290,02CR	343,08			
TIS	22 JUL 02	17 JUL 02	T C	1.050	5,217000	5.523,00CR	45,15CR			
Saldo liquidazione del:	22 JUL 02			Conto TERZI		38.975,55CR				

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti per il Comparto Azionario ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Conto**" indica se il conto è Proprio o Terzi (P o T);
- la colonna "**L/C**" indica se la posizione è lunga o corta.

## 2.3 Sezione III: Garanzie

Questa sezione descrive i tabulati delle specie di strumenti finanziari (titoli di Stato e azioni) depositati a garanzia.

### 2.3.1 RP-MA01 GARANZIE COLLATERALI COSTITUITE

Il tabulato in esame riporta le specie di titoli di Stato e azioni depositate a garanzia.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MA01

Ader: XXXX XXXXX		Garanzie Collaterali Costituite				RP-MA01	12 MAY 14	17:22:44	Pag. 1	
		CC&G - Maintenance - PT Environment								
Valuta: EUR - EURO		Contrattazioni del: 9 MAY 14								
Garanzie costituite dall'aderente nel conto :		TERZI								
D/P	N.Rif	Tipo	Garanzia	Valore Nom.	Prezzo	Classe	Haircut	Valore	Decorren.	Scadenza
				Unita'				Garanzia		
	55688	IT0004750409	BTP 01/07/2014	6.000.000	98,4900	02	2,00%	5.909.400,00	10 APR 13	1 JUL 14
Ammontare complessivo delle garanzie disponibili:						5.909.400,00				
Garanzie costituite dall'aderente nel conto :		PROPRIO								
D/P	N.Rif	Tipo	Garanzia	Valore Nom.	Prezzo	Classe	Haircut	Valore	Decorren.	Scadenza
				Unita'				Garanzia		
	55687	IT0004750409	BTP 01/07/2014	48.000.000	98,4900	02	2,00%	47.275.200,00	10 APR 13	1 JUL 14
	58555	IT0004682107	BTPSi 15/09/1	150.000.000	84,0000	12	20,00%	126.000.000,00	26 FEB 14	15 SEP 16
Ammontare complessivo delle garanzie disponibili:						173.275.200,00				

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ogni mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni e alle ore 16:00 circa per indicare i titoli di Stato e le azioni depositate e i valori di garanzia;
- la colonna "**D/P**" evidenzia, mediante i simboli D/P i titoli di Stato e/o azioni depositati (D) e prelevati (P) nel corso della giornata indicata nel tabulato stesso;
- nella colonna Tipo, i simboli "O" e "F", dopo il codice ISIN, indicano rispettivamente che lo strumento finanziario depositato è utilizzato a copertura di stock options o a copertura di stock futures;
- il valore di garanzia dei titoli di Stato è determinato moltiplicando il valore nominale per il prezzo. Il campo "**Valore Garanzia**" non è valorizzato per le azioni, stante le regole di loro utilizzo a fronte di particolari posizioni contrattuali;
- la colonna "**Scadenza**" può contenere: per i titoli di Stato, la data di rimborso del titolo o la dizione "Expired" se il titolo è scaduto; per le azioni, la data di liquidazione, se le stesse sono state vincolate per la consegna a seguito di un'assegnazione, la dizione "Expired" se le stesse sono già state prelevate e consegnate dalla Euronext Clearing al Servizio di Liquidazione, o nessuna indicazione negli altri casi;

- **l'“Ammontare complessivo delle garanzie disponibili”**, pari alla somma dei singoli valori di garanzia, è riferito ai soli titoli di Stato depositati e viene riportato anche nel tabulato RP-MS11.

## 2.3.2 RP-MA03 CONTROVALORE GARANZIE COLLATERALI

Il tabulato fornisce il dettaglio dei titoli di Stato depositati dal Partecipante Diretto nei conti (Proprio/MOA, ISA, AOA, GOSA e NOSA) aperti presso Euronext Clearing, indicandone il relativo controvalore e tenendo conto dei limiti di concentrazione stabiliti.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MA03

Ader: ABCD 12345 ABCD COMPANY LTD		Controvalore Garanzie Collaterali			RP-MA03	18 FEB 14	19:20:36		
Pag. 1									
CM: GKK 22222 GKK COMPANY									
Conto: TERZI									
<hr/>									
Valuta: EUR									
Paese: FRANCE									
Limite Paese (LP): 45,00 %									
Ser.No Data Scd	Cod. Isin	Descrizione	Tipo	Val.Nominale	Prezzo	HC	Cl	Val.Garanzia	Data Dep.
00001 2015/04/25	FR0010163543	OAT APR15 EUR 3,5	OAT	15.000.000,00	103,66	7,00 %	31	14.460.570,00	2014/02/05
00002 2017/07/25	FR0120746609	BTAN TF 1% LG17 EUR	BTAN	26.000.000,00	101,63	7,00 %	32	24.574.134,00	2014/02/05
Totale Val. Garanzia:								39.034.704,00	
Max Paese:								7.264.440,00	
Val. Garanzia utilizzabile dopo LP:								7.264.440,00	
Eccesso Paese:								31.770.264,00	
<hr/>									
Valuta: EUR									
Paese: ITALY									
Limite Paese (LP): 45,00 %									
Ser.No Data Scd	Cod. Isin	Descrizione	Tipo	Val.Nominale	Prezzo	HC	Cl	Val.Garanzia	Data Dep.
00003 2014/12/01	IT0004321813	CCTS 0.420 01/12/14	CCT	9.000.000	100,17	3,5%	03	8.496.920,25	2014/02/05
00004 2024/03/01	IT0004953417	BTPS 4.500 01/03/24	BTP	70.000.000	109,60	3,5%	09	63.294.000,00	2014/02/05
Totale Val. Garanzia:								71.790.920,25	
Max Paese:								7.264.440,00	
Val. Garanzia utilizzabile dopo LP:								7.264.440,00	
Eccesso Paese:								64.526.480,25	
<hr/>									
Limite Totale (LT):		50,00 %							
Margini Iniziali:		16.143.200,00							
Tot. Val. Garanzia dopo LP:		14.528.880,00							
Max Val. Garanzia utilizzabile (LT):		8.071.600,00							
Garanzie Collaterali utilizzate dopo LT:		8.071.600,00							
Eccesso LT:		6.457.280,00							
Totale Eccesso Paese (LP): 96.296.744,25									

- il tabulato viene prodotto per tutti i conti (Proprio/MOA, ISA, AOA, GOSA e NOSA) del Partecipante Diretto ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce;
- il campo "**Ader**" indica il codice mnemonico, il codice Ente e la denominazione del Partecipante Diretto o del conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) a cui si riferisce il tabulato;
- il campo "**CM**" è valorizzato solo se il tabulato è riferito ad un conto segregato ISA, AOA, GOSA o NOSA (indicato nel campo Ader) ed indica il codice mnemonico, il codice Ente e la denominazione del relativo Partecipante Diretto;
- il campo "**Conto**" indica il conto "Proprio" o "Terzi" del soggetto (Partecipante Diretto o suo conto segregato ISA, AOA, GOSA o NOSA) a cui si riferisce il tabulato;
- il campo "**Paese**" indica lo Stato di emissione dei titoli;
- il campo "**Limite Paese (LP)**": indica il limite di concentrazione stabilito per il Paese, ossia la percentuale massima di copertura dei Margini Iniziali consentita tramite titoli di Stato di quel determinato Paese;
- il campo "**Prezzo**" indica il prezzo attribuito da Euronext Clearing al titolo;
- Il campo "**Val. Garanzia**" indica il valore di garanzia di ciascun titolo depositato, tenuto conto del valore nominale e del prezzo;
- Il campo "**Totale Val. Garanzia**" indica il valore di garanzia complessivo dei titoli depositati per il Paese;
- il campo "**Max Paese**" indica il massimo valore di garanzia utilizzabile per il Paese, tenuto conto dei Margini Iniziali e del Limite Paese;
- il campo "**Val. Garanzia utilizzabile dopo LP**" indica, con riferimento ai titoli depositati, il valore di garanzia utilizzabile per il Paese, tenuto conto del "Max Paese"; il valore di garanzia che verrà utilizzato dipenderà dall'applicazione del successivo limite di concentrazione (Limite Totale LT).
- il campo "**Eccesso Paese**" indica il valore di garanzia in eccesso per il Paese e quindi restituibile al Partecipante;
- il campo "**Limite Totale (LT)**" indica il limite di concentrazione totale, ossia la percentuale massima di copertura dei Margini Iniziali consentita tramite titoli di Stato;
- il campo "**Margini Iniziali**" indica l'ammontare dei Margini Iniziali calcolati per il conto di riferimento;
- il campo "**Tot. Val. Garanzia dopo LP**" indica il valore di garanzia utilizzabile dopo l'applicazione del Limite Paese (somma dei Val. Garanzia utilizzabili dopo LP);
- il campo "**Max Val. Garanzia utilizzabile (LT)**": indica il massimo valore di garanzia in titoli utilizzabile a copertura dei Margini Iniziali, tenuto conto dell'ammontare dei Margini Iniziali e del Limite Totale;
- il campo "**Garanzie Collaterali utilizzate dopo LT**" indica il valore di garanzia complessivamente utilizzato a copertura dei Margini Iniziali, tenuto conto di entrambi i limiti di concentrazione (LP e LT);
- il campo "**Eccesso LT**" contiene la differenza tra il valore di garanzia utilizzabile a copertura dei Margini Iniziali - tenuto conto del Limite Paese (Tot. Val. Garanzia dopo LP) - e il valore di garanzia effettivamente utilizzato - tenuto conto del Limite Totale (Garanzie Collaterali utilizzate dopo LT);

- il campo "**Totale Eccesso Paese (LP)**" contiene la somma delle garanzia in eccesso di tutti i Paesi (somma degli "Eccesso Paese").

### 2.3.3 RP-MI01 MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI

Il tabulato è prodotto per i soli Partecipanti Diretti che abbiano fatto richiesta di copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri in Strumenti Finanziari e a cui Euronext Clearing richiede Margini Aggiuntivi Infragiornalieri dopo l'orario indicato all'Art B.3.1.2, comma 1, lettera c, delle Istruzioni.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MI01

Ader: BNK1		RP-MI01	2 NOV 17	14:05:30	Page 2
	Margini Iniziali	Cash	Collateral	Intraday Call	
BNK1/9999					
TERZI	2.575.086,82	,00	1.158.789,00	1.416.297,82	

- Il tabulato è prodotto separatamente per il Partecipante Diretto e per ciascun suo eventuale conto segregato (ISA, AOA, GOSA e NOSA) per cui sia stata attivata la richiesta di copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri in Strumenti Finanziari;
- per i Partecipanti Generali viene indicata anche la situazione relativa a ciascun Cliente Negoziatore;
- alla colonna "**Margini Iniziali**" sono riportate le competenze infragiornaliere (Margini Iniziali, Margini di Variazione e Premi);
- alla colonna "**Cash**" è indicato l'ammontare delle garanzie in contanti al momento disponibili sul conto del Partecipante presso Euronext Clearing al momento del calcolo dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri;
- alla colonna "**Collateral**" è indicato il controvalore delle garanzie in titoli di Stato al momento disponibili sul conto del Partecipante presso Euronext Clearing al momento del calcolo dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri;
- alla colonna "**Intraday Call**" è indicato l'ammontare dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri da coprire in titoli di Stato.

## 2.3.4 RP-MI02 CONTROVALORE GARANZIE COLLATERALI INFRAGIORNALIERE

Il tabulato, prodotto per i soli Partecipanti Diretti che abbiano fatto richiesta di copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri in Strumenti Finanziari e a cui Euronext Clearing richiede Margini Aggiuntivi Infragiornalieri dopo l'orario indicato all'Art B.3.1.2, comma 1, lettera c, delle Istruzioni.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MI02

Mbr: BNK1 /		Collaterals Deposited				RP-MI02		2 NOV 17 14:05:37		Page 1	
Gcm : BNK1 / Bank 1											
Account: CLIENT											
<hr/>											
Valuta:		EUR									
Paese:		FRANCE									
Limite Paese (LP):		45,00 %									
Ser.No	Cod. Isin	Descrizione	Tipo	Val.Nominale	Prezzo	HC	Cl	Val.Garanzia	Data Dep.	Data Scd	
47081	FR0010466938	OAT OTT23 EUR 4,25	OAT	20.000.000	120,288000	4,00	% 07	24.057.600,00	2017/05/25	2023/10/25	
Totale Val. Garanzia:								24.057.600,00			
Max Paese:								1.063.949,40			
Val. Garanzia utilizzabile dopo LP:								1.063.949,40			
Eccesso Paese:								22.993.650,60			
<hr/>											
Valuta:		EUR									
Paese:		ITALY									
Limite Paese (LP):		45,00 %									
Ser.No	Cod. Isin	Descrizione	Tipo	Val.Nominale	Prezzo	HC	Cl	Val.Garanzia	Data Dep.	Data Scd	
47080	IT0004716319	CCTeu 0.402 15/04/18	CCT	16.000.000	95,970815	4,50	% 13	15.355.330,40	2017/05/25	2018/04/15	
47077	IT0005174898	BTP ITALIA AP24 EUR		15.000.000	86,667361	15,00	% 12	13.000.104,15	2017/05/23	2024/04/11	
Totale Val. Garanzia:								28.355.434,55			
Max Paese:								1.063.949,40			
Val. Garanzia utilizzabile dopo LP:								1.063.949,40			
Eccesso Paese:								27.291.485,15			
<hr/>											
Limite Totale (LT):				50,00 %							
Margini Iniziali:				2.364.332,00							
Tot. Val. Garanzia dopo LP:				2.127.898,80							
Max Val.Garanzia utilizzabile(LT):				1.182.166,00							
Garanzie Collat.Utilizzate dopo LT:				1.182.166,00							
Eccesso LT:				945.732,80				Totale Eccesso Paese (LP): 50.285.135,75			
Copertura Parziale Margini Intraday											
<hr/>											
Initial Margin....:		2.364.332,00									
Cash.....:		500.000,00									
Collateral.....:		1.182.166,00									
Previous Cash call:		,00									
Cash call...:		682.166,00									

Il tabulato è prodotto per tutti i Clearing Member e per ciascun conto segregato (ISA, AOA, GOSA e NOSA) ed è disponibile per tutti i Clearing Member che hanno la possibilità di coprire le

richieste di Margini Aggiuntivi Infragiornalieri ricevute durante il pomeriggio in titoli di stato. Euronext Clearing invia il report ogni volta che una richiesta di Margini Aggiuntivi Infragiornalieri è stata effettuata e ogni volta che il Clearing Member deposita titoli a copertura di tali richieste.

- il campo "**Ader**" indica il codice mnemonico, il codice Ente e la denominazione del Partecipante Diretto o del conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) a cui si riferisce il tabulato;
- il campo "**CM**" è valorizzato solo se il tabulato è riferito ad un conto segregato ISA, AOA, GOSA o NOSA (indicato nel campo Ader) ed indica in tal caso il codice mnemonico, il codice Ente e la denominazione del relativo Partecipante Diretto;
- il campo "**Conto**" indica il conto "Proprio" o "Terzi" del soggetto (Partecipante Diretto o suo conto segregato ISA, AOA, GOSA o NOSA) a cui si riferisce il tabulato;
- il campo "**Paese**" indica lo Stato di emissione dei titoli;
- il campo "**Limite Paese (LP)**": indica il limite di concentrazione stabilito per il Paese, ossia la percentuale massima di copertura dei Margini Iniziali consentita tramite titoli di Stato di quel determinato Paese;
- il campo "**Prezzo**" indica il prezzo attribuito da Euronext Clearing al titolo di Stato;
- Il campo "**Val. Garanzia**" indica il valore di garanzia di ciascun titolo di Stato depositato, tenuto conto del valore nominale e del prezzo;
- Il campo "**Totale Val. Garanzia**" indica il valore di garanzia complessivo dei titoli depositati per il Paese;
- il campo "**Max Paese**" indica il massimo valore di garanzia utilizzabile per il Paese, tenuto conto dei Margini Iniziali e del Limite Paese;
- il campo "**Val. Garanzia utilizzabile dopo LP**" indica, con riferimento ai titoli di Stato depositati, il valore di garanzia utilizzabile per il Paese, tenuto conto del "Max Paese"; il valore di garanzia che verrà utilizzato dipenderà dall'applicazione del successivo limite di concentrazione (Limite Totale LT).
- il campo "**Eccesso Paese**" indica il valore di garanzia in eccesso per il Paese;
- il campo "**Limite Totale (LT)**" indica il limite di concentrazione totale, ossia la percentuale massima di copertura dei Margini Iniziali consentita tramite titoli di Stato;
- il campo "**Margini Iniziali**" indica l'ammontare dei Margini Iniziali calcolati per il conto di riferimento;
- il campo "**Tot. Val. Garanzia dopo LP**" indica il valore di garanzia utilizzabile dopo l'applicazione del Limite Paese (somma dei Val. Garanzia utilizzabili dopo LP);
- il campo "**Max Val. Garanzia utilizzabile (LT)**": indica il massimo valore di garanzia in titoli utilizzabile a copertura dei Margini Iniziali, tenuto conto dell'ammontare dei Margini Iniziali e del Limite Totale;
- il campo "**Garanzie Collaterali utilizzate dopo LT**" indica il valore di garanzia complessivamente utilizzato a copertura dei Margini Iniziali, tenuto conto di entrambi i limiti di concentrazione (LP e LT);
- il campo "**Eccesso LT**" contiene la differenza tra il valore di garanzia utilizzabile a copertura dei Margini Iniziali - tenuto conto del Limite Paese (Tot. Val. Garanzia dopo LP) - e il valore di garanzia effettivamente utilizzato - tenuto conto del Limite Totale (Garanzie Collaterali utilizzate dopo LT);

- il campo "**Totale Eccesso Paese (LP)**" contiene la somma delle garanzie in eccesso di tutti i Paesi (somma degli "Eccesso Paese");
- Il campo "**Cash Call**" rappresenta l'ammontare dei Margini Addizionali Intraday non coperto da titoli e da versare in cash.

## 2.4 Sezione IV: Regolamento Margini e Default Fund

Questa sezione descrive i tabulati della posizione finanziaria, del Default Fund, dei margini iniziali e intraday, della notifica o della richiesta di pagamento.

### 2.4.1 RP-MS52 AVVISO DI ADDEBITO/ACCREDITO

Il tabulato, inviato ai Partecipanti Diretti o ai relativi Agenti di Regolamento, mostra i pagamenti da regolare nella giornata relativi al regolamento giornaliero dei margini, alle penali T2S e ICSD, ai Default Fund e alle restituzioni di contante in eccesso attivate in via permanente. Il tabulato non riporta i pagamenti relativi alle restituzioni di contante in eccesso richieste nella giornata, né i pagamenti relativi ai Margini Infragiornalieri (riportati sui tabulati MS33 e MS35).

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS52

Ader.:BANU BANCA UNO SPA Avviso di Addebito/Accredito RP- MS52 1 MAR 16 7:30:35 Page 1  
Banca:BANU BANCA UNO SPA Contrattazioni Del: 29 FEB 16

Valuta: EUR - EURO

Ai sensi dell'Articolo B.5.1.1 del Regolamento, si richiede di rendere capiente il Conto PM nel Sistema Target2 sul quale sarà effettuato da CC&G l'addebito diretto degli importi di seguito indicati:

Aderente	Conto	T.Adese.	Ragione Sociale	Codice	Causale	Ammontare
BANU/5099		Diretto	BANCA UNO SPA	05099	BOR MDF	150.128,10
BAND/5033	PROPRIO	Diretto	BANCA DUE SPA	05033	MIF ADG	40.150,22
ABAB/6888	PROPRIO	Segregato	ABAB CONTO ISA	16888	MIF ADG	72.930,09
-----						
Totale						263.208,41

L'addebito inizierà alle ore 9.00 e terminerà alle ore 9.30 del: 2 MAR 16

-----  
Ader.:BANU BANCA UNO SPA Avviso di Addebito/Accredito RP- MS52 1 MAR 16 7:30:35 Page 2  
Banca:BANU BANCA UNO SPA Contrattazioni Del: 29 FEB 16

Valuta: EUR - EURO

Si informa che stiamo accreditando sul Vostro Conto PM i seguenti importi per conto di:

Aderente	Conto	T.Adese.	Ragione Sociale	Codice	Causale	Ammontare
BANU/XXXX	PROPRIO	Diretto	BANCA UNO SPA	05099	MIF RES	10.160.187,00
BAND/		Diretto	BANCA DUE SPA	05033	BOR MMT	2.052.810,48
CBCB/XXXX	TERZI	Diretto	CBCB CONTO ISA	18877	MIF ADG	3.135.197,96
ABCD/XXXX	PROPRIO	Segregato	XXXX CONTO AOA	99988	MIF RES	14.855.545,30
-----						
Totale						30.203.740,74

Gli accrediti verranno effettuati con valuta odierna 2 MAR 16

- Il tabulato è disponibile il giorno di pagamento, prima dell'inizio della fase di addebito;
- A pagina 1 sono indicati i pagamenti a debito dei Partecipanti, da regolare entro le ore 9:30, mentre a pagina 2 sono indicati i pagamenti a credito;
- Alla voce **Aderente** è indicato il codice alfabetico del Partecipante Diretto o del conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) a cui è riferito il pagamento;

- Alla voce **Conto** è indicato il conto (Proprio o Terzi) del Partecipante o del conto segregato a cui è riferito il pagamento; il conto non è indicato se il pagamento è relativo a un Default Fund;
- Alla voce **T.Adess** è indicato "Diretto" se il pagamento è riferito ad un Partecipante Diretto, o "Segregato" se il pagamento è riferito ad un conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) di un Partecipante Diretto;
- Alla voce **Ragione Sociale** è indicata la denominazione sociale del Partecipante o del conto segregato;
- Alla voce **Codice** è indicato il codice Ente del Partecipante o del conto segregato;
- Alla voce **Causale** è indicata la causale di pagamento; le possibili causali sono le seguenti:
  - **MIF ADG** = regolamento giornaliero dei margini;
  - **MIF RES** = restituzione di contante in eccesso attivata in via permanente;
  - **MIF PET** = pagamenti delle penali di Settlement con provenienza T2S;
  - **MIF PEI** = pagamenti delle penali di Settlement con provenienza ICSD;
  - **BOR MDF** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari;
  - **BOR MMT** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD ;
  - **BOR IDF** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per i Comparti Azionario e Derivati Azionari;
  - **BOR IMT** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per i Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD;
- Alla voce **Ammontare** è indicato l'importo da regolare.

## 2.4.2 RP-MS53 PAGAMENTI GIORNALIERI PER IL PARTECIPANTE DIRETTO

Il tabulato contiene tutti i pagamenti a credito e a debito da regolare nella giornata da parte del Partecipante Diretto per tutti i suoi conti (compresi i conti segregati) fatta eccezione per i pagamenti relativi ai Margini infragiornalieri e le restituzioni di contante in eccesso non attivate in via permanente.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS53

Ader.:BANU BANCA UNO SPA    Pagamenti giornalieri Part. Diretto    RP-MS53    1 MAR 16    7:30:35 Page1						
Contrattazioni Del: 29 FEB 16						
Valuta:    EUR - EURO						
I seguenti importi a debito saranno regolati con valuta odierna 1 MAR 16:						
Aderente	Conto	T.Adese.	Ragione Sociale	Codice	Causale	Ammontare
BANU		Diretto	BANCA UNO SPA	05099	BOR MDF	150.128,10
BANU	TERZI	Diretto	BANCA UNO SPA	05099	MIF ADG	2.540,78
ABAB	PROPRIO	Segregato	ABAB CONTO ISA	16888	MIF ADG	72.930,09
						-----
Totale						225.598,97
-----						
Ader.: BANCA ABCD SPA    Pagamenti giornalieri Part. Diretto    RP-MS53    1 MAR 16    7:30:35 Page 2						
Contrattazioni Del: 29 FEB 16						
Valuta:    EUR - EURO						
I seguenti importi a credito saranno regolati con valuta odierna 1 MAR 16:						
Aderente	Conto	T.Adese.	Ragione Sociale	Codice	Causale	Ammontare
BANU	PROPRIO	Diretto	BANCA UNO SPA	05099	MIF RES	10.160.187,00
ABAB	TERZI	Segregato	ABAB CONTO ISA	16888	MIF ADG	14.855.545,30
						-----
Totale						25.015.732,30

- Il tabulato è disponibile il giorno di pagamento, prima dell'inizio della fase di addebito;
- A pagina 1 sono indicati i pagamenti a debito del Partecipante Diretto, da regolare entro le ore 9:30, mentre a pagina 2 sono indicati i pagamenti a credito;
- Alla voce **Aderente** è indicato il codice alfabetico del Partecipante Diretto o del conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) a cui è riferito il pagamento;

- Alla voce **Conto** è indicato il conto (Proprio o Terzi) del Partecipante o del conto segregato a cui è riferito il pagamento; il conto non è indicato se il pagamento è relativo a un Default Fund;
- Alla voce **T.Adess** è indicato "Diretto" se il pagamento è riferito al Partecipante Diretto, o "Segregato" se il pagamento è riferito ad un conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) dello stesso;
- Alla voce **Ragione Sociale** è indicata la denominazione sociale del Partecipante Diretto o del conto segregato;
- Alla voce **Codice** è indicato il codice Ente del Partecipante o del conto segregato;
- Alla voce **Causale** è indicata la causale di pagamento; le possibili causali sono le seguenti:
  - **MIF ADG** = regolamento giornaliero dei margini;
  - **MIF RES** = restituzione di contante in eccesso attivata in via permanente;
  - **MIF PET** = pagamenti delle penali di Settlement con provenienza T2S;
  - **MIF PEI** = pagamenti delle penali di Settlement con provenienza ICSD;
  - **BOR MDF** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari;
  - **BOR MMT** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD;
  - 
  - **BOR IDF** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per i Comparti Azionario e Derivati Azionari;
  - **BOR IMT** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per i Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD;
- Alla voce **Ammontare** è indicato l'importo da regolare.

### 2.4.3 RP-MS01 SINTESI GIORNALIERA

Il tabulato RP-MS01 è prodotto solo per i Partecipanti Diretti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS01

Ader: : GKK	Sintesi Giornaliera	RP-MS01	17 JAN 01 20:50:25 Pag. 1
Valuta: EURO	CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		
	Contrattazioni del: 17 JAN 01		
	Conto Proprio	Conto Terzi	
Margini Iniziali	4.906.908,75	8.451.833,99	
Garanzie Collaterali Disponibili	,00	3.829.826,08	
	-----	-----	
Integrazione Margini Iniziali	4.906.908,75	4.622.007,91	
Garanzie Collaterali in Eccesso	,00	,00	
Integrazione altri margini iniziali	,00	,00	
Contante presso Cassa	3.478.072,50	6.582.326,62	
Margini Iniziali Scoperti	1.428.836,25	,00	
Contante Residuo	,00	1.960.318,71	
Competenze			
Margini di Variazione sui Futures	1.050.425,00DR	401.141,00DR	
Margini di Variazione sulle Options	,00	,00	
Premi Options	,00	2.861,00DR	
Pagamento E/A	,00	,00	
Trasferim.Contante/Buy-in	,00	,00	
Commissioni	,00	,00	
Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento	,00	,00	
Adesione/Servizi Clearing/Buy-In	,00	,00	
Interessi	,00	,00	
Competenze Nette	1.050.425,00DR	404.002,00DR	
Competenza Nette da altri mercati	,00	,00	
	-----	-----	
Contante in Eccesso	,00	1.556.316,71	
	-----	-----	
Importo A Credito/Debito	2.479.261,25DR	,00	

Il tabulato non è utilizzabile per la verifica degli importi da regolare nell'ambito del regolamento giornaliero dei margini, né per la verifica delle garanzie depositate e in eccesso. Tali importi sono infatti riscontrabili nei tabulati RP-MS11 del Partecipante Diretto e dei suoi eventuali conti segregati (ISA, AOA, GOSA e NOSA). Il tabulato riporta le seguenti informazioni:

- alla colonna conto Proprio, gli stessi valori indicati alla colonna conto Proprio del tabulato RP-MS11 dello stesso Partecipante Diretto;
- alla colonna conto Terzi, la somma algebrica dei valori indicati alla colonna conto Terzi del tabulato RP-MS11 del Partecipante Diretto e alle colonne conto Proprio e conto Terzi dei tabulati RP-MS11 relativi ai conti segregati (ISA, AOA, GOSA e NOSA) del Partecipante Diretto.

## 2.4.4 RP-MS11 POSIZIONE FINANZIARIA

Il tabulato è prodotto per i Partecipanti Diretti e i relativi conti segregati (ISA, AOA, GOSA e NOSA), è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni ed è utilizzabile per la verifica degli importi da regolare nell'ambito del regolamento giornaliero dei margini.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS11

Ader: XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX		Posizione Finanziaria	RP-MS11	9 FEB 14	22:08:53	Pag.
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				
Valuta: EUR - EURO	Contrattazioni del: 7 FEB 14					
	Conto Proprio	Conto Terzi				
Margini Iniziali	89.000,00	,00				
Garanzie Collaterali Disponibili	,00	,00				
-----						
Integrazione Margini Iniziali	89.000,00	,00				
Garanzie Collaterali in Eccesso	,00	,00				
Contante presso Cassa	500,00	,00				
Margini Iniziali Scoperti	88.500,00	,00				
Contante Residuo	,00	,00				
Competenze						
Margini di Variazione sui Futures	,00	,00				
Margini di Variazione sulle Options	,00	,00				
Premi Options	,00	,00				
Pagamento E/A	,00	,00				
Trasferim.Contante/Buy-in/Penali	,00	,00				
Commissioni	,00	,00				
Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento	,00	,00				
Adesione/Servizi Clearing/Buy-In	,00	,00				
Interessi	,00	,00				
Competenze Nette	,00	,00				
-----						
Contante in Eccesso	,00	,00				
-----						
Credito/Debito	88.500,00DR	,00	Importo A			

- Alla voce **Margini Iniziali** è indicato l'ammontare dei Margini Iniziali calcolati sul conto;
- Alla voce **Garanzie Collaterali disponibili** è indicato il valore di garanzia dei titoli di Stato depositati sul conto, considerati i prezzi e gli haircut ma non i limiti di concentrazione;
- Alla voce **Integrazione Margini Iniziali** è indicato l'ammontare dei Margini Iniziali non coperto da titoli di Stato e che deve essere quindi coperto in contante;
- Alla voce **Garanzie Collaterali in Eccesso** è indicato il valore di garanzia dei titoli di Stato depositati sul conto non utilizzato per la copertura dei Margini Iniziali. Tale valore non può essere considerato utile ai fini della compilazione delle richieste di restituzione titoli; a tal fine bisognerà infatti fare riferimento al report RP-MA03 (voci "Eccesso Paese" e "Limite LT");
- Alla voce **Contante presso Cassa** è indicato il contante depositato in garanzia sul conto;
- Alla voce **Margini Iniziali Scoperti** è indicato l'ammontare dei Margini Iniziali non coperto dalle garanzie in titoli di Stato e in contante depositate sul conto;

- Alla voce **Contante Residuo** è indicato il contante depositato sul conto, non utilizzato a copertura dei Margini Iniziali;
- Alla voce **Margini di Variazione sui Futures** (CR = credito; DR = debito) è indicato l'ammontare dei Margini di Variazione calcolato su contratti e posizioni Futures. Il giorno di scadenza, a tale voce è inoltre indicato l'ammontare relativo al regolamento del differenziale delle posizioni in Futures con liquidazione in contante;
- La voce **Margini di Variazione sulle Options** non è attualmente utilizzata;
- Alla voce **Premi Options** (CR = credito; DR = debito) è indicato l'ammontare dei Premi calcolato sui contratti Options;
- Alla voce **Pagamento E/A** (CR = credito; DR = debito) è indicato l'ammontare relativo al regolamento del differenziale delle posizioni in opzioni su indici di Borsa esercitate/assegnate;
- La voce **Trasferim.Contante/Buy-in/Penali** (CR = credito; DR = debito) può contenere ammontari a credito o a debito per ragioni varie (differenziali Buy-In, rettifica di importi relativi a giornate precedenti, penali, ecc.);
- Alla voce **Commissioni** sono indicate le commissioni di clearing;
- Alla voce **Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento** sono indicate le commissioni sui titoli depositati a garanzia e le commissioni per i pagamenti effettuati in ritardo.
- Alla voce **Adesione/Servizi Clearing/Buy-In** sono indicate le quote annue di adesione, le commissioni per i servizi di clearing ICWS e BCS e le commissioni di Buy-In;
- Alla voce **Interessi** (CR = credito; DR = debito) è indicato l'ammontare degli interessi calcolati sul contante depositato sul conto;
- Alla voce **Competenze Nette** è indicata la somma algebrica delle "Competenze" (Margini di Variazione sui Futures, Premi Options, Pagamento E/A, Trasferim.Contante/Buy-in/Penali, Commissioni, Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento, Adesione/Servizi Clearing/Buy-In, Interessi);
- Alla voce **Contante in Eccesso** è indicato il contante che può essere richiesto in restituzione perché in eccesso rispetto a quanto necessario per la copertura di Margini Iniziali e Competenze;
- Alla voce **Importo A Credito/Debito** (CR = credito; DR = Debito) è indicato l'importo a credito o a debito da regolare entro le ore 9:30 in Target2 nell'ambito del regolamento giornaliero dei Margini.
- il dettaglio delle seguenti voci del tabulato RP-MS11 è indicato nei tabulati di seguito richiamati:

Margini Iniziali:	RP-MS00
Garanzie Collaterali Disponibili:	RP-MA01, RP-MA03
Margini di Variazione sui Futures:	RP-MT55,
Premi Options:	RP-MT05
Pagamento E/A:	RP-MT02
Commissioni:	RP-MT48, RP-MT47, RP-MFM4, RP-MFM6, RP-MFM8, RP-MFM9
Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento:	RP-MT48
Adesione/Servizi Clearing/Buy-In:	RP-MT48, MT36, MT37
Interessi:	RP-MS05

## 2.4.5 RP-MS12 DETTAGLIO POSIZIONE FINANZIARIA

Il tabulato fornisce il dettaglio della posizione finanziaria del conto MOA di ciascun Partecipante Generale. Verrà quindi prodotto un tabulato RP-MS12 per il Partecipante Generale e un altro per ciascun Cliente Negoziatore del conto Main Omnibus dello stesso.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS12

Ader: XXXX XXXXXXXXXXXXXXXX	Dettaglio Posizione Finanziaria MOA		RP-MS12	9 FEB 14	22:08:54	Pag. 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Valuta: EUR - EURO	Contrattazioni del: 7 FEB 14					
	Conto Proprio	Conto Terzi				
Margini Iniziali	4.859.212,00	,00	Competenze			
Margini di Variazione sui Futures	,00	,00				
Margini di Variazione sulle Options	,00	,00				
Premi Options	,00	,00				
Pagamento E/A	,00	,00				
Trasferim.Contante/Buy-in/Penali	,00	,00				
Commissioni	,00	,00				
Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento	,00	,00				
Adesione/Servizi Clearing/Buy-In	,00	,00				
Interessi	,00	,00				
Competenze Nette	,00	,00				

- il tabulato è disponibile ogni giorno, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- il tabulato intestato al Partecipante Generale riporta esclusivamente la posizione finanziaria dello stesso Partecipante Generale in conto Proprio e in conto Terzi (clienti non segregati), escludendo quella dei Clienti Negoziatori;
- il tabulato intestato al Cliente Negoziatore riporta esclusivamente la posizione finanziaria dello stesso Cliente Negoziatore, escludendo quella degli altri Clienti Negoziatori e quella del Partecipante Generale;
- il dato aggregato è fornito nella colonna "Conto Terzi" del report RP-MS11 intestato al Partecipante Generale.

## 2.4.6 RP-MS61 MARGINI INIZIALI COMPARTO OBBLIGAZIONARIO – POSIZIONI MARGINABILI

Il presente tabulato ed i successivi, sino al tabulato RP-MS70, illustra le diverse componenti dei margini iniziali calcolati per il Comparto Obbligazionario. Il presente report elenca le posizioni marginabili.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS61

Ader: CCG		M.I. Comp. Obblig. posizioni marginabili AL 1 MAR 17 MS61 1 MAR 17 19:32:09 Page									
POSIZIONI SELEZIONATE											
GCM	:	GKK									
Aderente:	:	GKK									
Conto	:	F	Sottoconto:								
Valuta	:	EUR									
ISIN	Tipo	L/S	Numero	Data	Data	Quantità	Controvalore	Repo	Tasso	Group	Grou
			Contratto	Contratto	Regolam.				Repo	Regol	Coll
ES00000121S7	OBE	L	0000000071	22 FEB 17	02 MAR 17	5.000.000	5.133.918,00	T	0,9000	BOND	A
ES00000128C6	OBE	L	0000000090	01 MAR 17	02 MAR 17	7.000.000	7.127.075,90	T	0,7000	BOND	A
IT0003644769	BTP	L	0000000039	27 FEB 17	02 MAR 17	2.000.000	1.986.961,40	T	0,5100	BOND	A
IT0004532559	BTP	L	0000000041	27 OCT 16	31 OCT 17	1.000.000	995.987,30	T	0,0200	BOND	A

- il tabulato viene prodotto per i Partecipanti al Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD che abbiano scelto Euronext Clearing come CCP ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- per ulteriori dettagli sulle modalità di determinazione dei Margini iniziali per il Comparto Obbligazionario e per il Comparto Obbligazionario ICSD si rimanda al Manuale MVP disponibile sul sito web di Euronext Clearing ([www.euronext.com](http://www.euronext.com)) alla sezione [Risk Management>Metodologie](#).

## 2.4.7 RP-MS62 MARGINI INIZIALI COMPARTO OBBLIGAZIONARIO - MARK-TO-MARKET

Il presente tabulato indica lo sviluppo del calcolo della componente mark-to-market dei margini iniziali.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS62

Ader: CCG		M.I. Comparto Obbl. Mark to Market				AL	1 MAR 17	MS62	1 MAR 17	19:32:11	Page
GCM : GKK											
Aderente: GKK											
Conto : F		Sottoconto:									
Valuta : EUR		EUR									
ISIN	L/S	Controvalore	Prezzo	Rateo	Prezzo	Coeff	Quantità	Controvalore	Interessi	Margi	
		Negoziato	MIM	Cedola	Rivalutato	Ind	Negoziata	Rivalutato	Repo	Mark-to-Mark	
ES00000121S7	L	5.133.918,00	143,530	2,76849	146,298490		5.000.000	7.314.924,50	898,00	2.180.108,5	
ES00000128C6	L	7.127.075,90	106,640	0,96932	107,609320		7.000.000	7.532.652,40	139,00	405.437,5	
IT0003644769	L	1.986.961,40	112,050	0,36050	112,410500		2.000.000	2.248.210,00	28,00	261.220,6	
IT0004532559	L	995.987,30	131,230	0,01359	131,243590		1.000.000	1.312.435,90	68,00	316.380,6	
Totale Aderente										3.163.147,2	

- *Come RP-MS61*

## 2.4.8 RP-MS63 MARGINI INIZIALI COMPARTO OBBLIGAZIONARIO – ATTRIBUZIONE CLASSI

Il tabulato riporta l'attribuzione alla classe di "duration" dei prodotti finanziari contrattati sulla base della "duration".

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS63

Ader		M.I. Comp.Obbligazionario attr. classi		AL	1 MAR 17	MS63	1 MAR 17	19:32:23	Page
GCM	: GKK								
Aderente:	GKK								
Conto	: F	Sottoconto:							
Valuta	: EUR								
Paese	: ES	SPAIN							
ATTRIBUZIONE DELLE CLASSI									
ISIN	Posizione	Posizione	Rendimento	Duration	Classe				
	Lunga	Corta	Effettivo						
ES00000121S7	7.314.924,50	0,00	0,023388	16,3480	11 ES				
ES00000128C6	7.532.652,40	0,00	0,025767	20,4405	11 ES				
GCM	: GKK								
Aderente:	GKK								
Conto	: F	Sottoconto:							
Valuta	: EUR								
Paese	: IT	ITALY							
ATTRIBUZIONE DELLE CLASSI									
ISIN	Posizione	Posizione	Rendimento	Duration	Classe				
	Lunga	Corta	Effettivo						
IT0003644769	2.248.210,00	0,00	0,003524	2,7696	06 IT				
IT0004532559	1.312.435,90	0,00	0,031158	15,0606	11 IT				

- Come RP-MS61.

## 2.4.9 RP-MS64 MARGINI INIZIALI COMPARTO OBBLIGAZIONARIO – ABBATTIMENTO INTRA-CLASSE

Il tabulato elenca la percentuale di abbattimento applicata su ciascuna classe, tenendo conto delle correlazioni tra posizioni di segno contrario nell'ambito della stessa classe.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS64

Ader		M.I. Comp. Obbl. abbatt. intra classe		AL	1 MAR 17	MS64	1 MAR 17	19:32:25	Page
GCM	: GKK								
Aderente:	GKK								
Conto	: F	Sottoconto:							
Valuta	: EUR								
Paese	: ES	SPAIN							
ABBATTIMENTO INTRA CLASSE									
Classe	Posizione Lunga	Posizione Corta	Percent. Riduzio.	Importo Riduzione	Posizione Lunga Ridotta	Posizione Corta Ridotta			
ES 01	0,00	0,00	5,00%	0,00	0	0			
ES 02	0,00	0,00	20,00%	0,00	0	0			
ES 03	0,00	0,00	50,00%	0,00	0	0			
ES 04	0,00	0,00	80,00%	0,00	0	0			
ES 05	0,00	0,00	65,00%	0,00	0	0			
ES 06	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
ES 07	0,00	0,00	75,00%	0,00	0	0			
ES 08	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
ES 09	0,00	0,00	75,00%	0,00	0	0			
ES 10	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
ES 11	14.847.576,90	0,00	55,00%	0,00	14.847.577	0			
ES 12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
Ader									
M.I. Comp. Obbl. abbatt. intra classe		AL	1 MAR 17	MS64	1 MAR 17	19:32:25	Page		
GCM	: GKK								
Aderente:	GKK								
Conto	: F	Sottoconto:							
Valuta	: EUR								
Paese	: IT	ITALY							
ABBATTIMENTO INTRA CLASSE									
Classe	Posizione Lunga	Posizione Corta	Percent. Riduzio.	Importo Riduzione	Posizione Lunga Ridotta	Posizione Corta Ridotta			
IT 01	0,00	0,00	5,00%	0,00	0	0			
IT 02	0,00	0,00	20,00%	0,00	0	0			
IT 03	0,00	0,00	50,00%	0,00	0	0			
IT 04	0,00	0,00	80,00%	0,00	0	0			
IT 05	0,00	0,00	65,00%	0,00	0	0			
IT 06	2.248.210,00	0,00	70,00%	0,00	2.248.210	0			
IT 07	0,00	0,00	75,00%	0,00	0	0			
IT 08	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
IT 09	0,00	0,00	75,00%	0,00	0	0			
IT 10	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
IT 11	1.312.435,90	0,00	55,00%	0,00	1.312.436	0			
IT 12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
IT 13	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
IT 31	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
IT 32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
IT 33	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
IT 34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
IT 35	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			

- Come RP-MS61

## 2.4.10 RP-MS65 MARGINI INIZIALI COMPARTO OBBLIGAZIONARIO – ABBATTIMENTO INTER-CLASSI

Il tabulato elenca la percentuale di abbattimento applicata su ciascuna classe, tenendo conto delle correlazioni tra posizioni di segno contrario fra classi contigue.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS65

Ader		M.I.Comparto Obbl. abbatt. inter-classi		AL	1 MAR 17	MS65	1 MAR 17	19:32:26	Page
GCM	: GKK								
Aderente:	GKK								
Conto	: F	Sottoconto:							
Valuta	: EUR								
Paese	: ES	SPAIN							
ABBATTIMENTO INTER CLASSE									
Classe A									
Priorità	Classe	Posizione	Posizione	Percentuale	Posizione	Posizione	Percentuale	Posizione	Posizione
A -- B		Lunga	Corta	Riduzione	Lunga	Corta	Riduzione	Lunga	Corta
001	02 03 ES	0	0	20,00%	0	0	20,00%	0	0
002	03 04 ES	0	0	40,00%	0	0	40,00%	0	0
003	04 05 ES	0	0	40,00%	0	0	40,00%	0	0
004	04 06 ES	0	0	20,00%	0	0	20,00%	0	0
005	05 06 ES	0	0	40,00%	0	0	40,00%	0	0
006	05 07 ES	0	0	25,00%	0	0	25,00%	0	0
007	06 07 ES	0	0	45,00%	0	0	45,00%	0	0
008	06 08 ES	0	0	25,00%	0	0	25,00%	0	0
009	06 09 ES	0	0	15,00%	0	0	15,00%	0	0
010	07 08 ES	0	0	45,00%	0	0	45,00%	0	0
011	07 09 ES	0	0	30,00%	0	0	30,00%	0	0
012	07 10 ES	0	0	20,00%	0	0	20,00%	0	0
013	08 09 ES	0	0	50,00%	0	0	50,00%	0	0
014	08 10 ES	0	0	35,00%	0	0	35,00%	0	0
015	09 10 ES	0	0	55,00%	0	0	55,00%	0	0
016	09 11 ES	0	0	25,00%	14.847.577	0	25,00%	14.847.577	0
017	10 11 ES	0	0	40,00%	14.847.577	0	40,00%	14.847.577	0
Ader									
GCM		M.I.Comparto Obbl. abbatt. inter-classi		AL	1 MAR 17	MS65	1 MAR 17	19:32:26	Page
Aderente:									
Conto		Sottoconto:							
Valuta									
Paese		ITALY							
ABBATTIMENTO INTER CLASSE									
Classe A									
Priorità	Classe	Posizione	Posizione	Percentuale	Posizione	Posizione	Percentuale	Posizione	Posizione
A -- B		Lunga	Corta	Riduzione	Lunga	Corta	Riduzione	Lunga	Corta
001	02 03 IT	0	0	20,00%	0	0	20,00%	0	0
002	03 04 IT	0	0	35,00%	0	0	35,00%	0	0
003	04 05 IT	0	0	40,00%	0	0	40,00%	0	0
004	04 06 IT	0	0	20,00%	2.248.210	0	20,00%	2.248.210	0
005	05 06 IT	0	0	40,00%	2.248.210	0	40,00%	2.248.210	0
006	05 07 IT	0	0	25,00%	0	0	25,00%	0	0
007	06 07 IT	2.248.210	0	45,00%	0	0	45,00%	0	0
008	06 08 IT	2.248.210	0	25,00%	0	0	25,00%	0	0
009	06 09 IT	2.248.210	0	15,00%	0	0	15,00%	0	0
010	07 08 IT	0	0	45,00%	0	0	45,00%	0	0
011	07 09 IT	0	0	30,00%	0	0	30,00%	0	0
012	07 10 IT	0	0	20,00%	0	0	20,00%	0	0
013	08 09 IT	0	0	50,00%	0	0	50,00%	0	0
014	08 10 IT	0	0	35,00%	0	0	35,00%	0	0
015	09 10 IT	0	0	50,00%	0	0	50,00%	0	0
016	09 11 IT	0	0	30,00%	1.312.436	0	30,00%	1.312.436	0
017	10 11 IT	0	0	40,00%	1.312.436	0	40,00%	1.312.436	0

- Come RP-MS61.

## 2.4.11 RP-MS67 MARGINI INIZIALI COMPARTO OBBLIGAZIONARIO – MARGINE FINALE

Il report riporta il calcolo finale dei margini iniziali sommando la componente mark-to-market e la componente di margine ordinario.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS67

M.I. Comparto Obbl. margine finale					AL	MS67	1 MAR 17	19:32:27	Page
GCM	:	GRK							
Aderente:	:	GRK							
Conto	:	F	Sottoconto:						
Valuta	:	EUR							
Paese	:	ES	SPAIN						
MARGINE FINALE									
Classe		Posizione	Posizione	Intervallo	Margine non				
		Lunga	Corta	Margine	Rettificato				
	ES 11	14.847.577	0	23,70%	3.518.876				
					Totale Margine non Rettificato	3.518.876			
					Parametro di Modulazione Partecipante	0,000 %			
					Margini Ordinari	3.518.876			
					Margini Mark-to-Market	2.585.546CR			
					Margini Iniziali	933.330			
Valuta	:	EUR							
Paese	:	IT	ITALY						
MARGINE FINALE									
Classe		Posizione	Posizione	Intervallo	Margine non				
		Lunga	Corta	Margine	Rettificato				
	IT 06	2.248.210	0	3,15%	70.819				
	IT 11	1.312.436	0	13,50%	177.179				
					Totale Margine non Rettificato	247.998			
					Parametro di Modulazione Partecipante	0,000 %			
					Margini Ordinari	247.998			
					Margini Mark-to-Market	577.601CR			
					Margini Iniziali	0			
Valuta	:	USD							
Paese	:	IT	ITALY						
MARGINE FINALE									
Classe		Posizione	Posizione	Intervallo	Margine non				
		Lunga	Corta	Margine	Rettificato				
					Totale Margine non Rettificato	0			
					Parametro di Modulazione Aderente	0,000 %			
					Margini Ordinari	0			
					Margini Mark-to-Market	0			
					Margini Iniziali	0			

- Come RP-MS61.

## 2.4.12 RP-MS70 MARGINI INIZIALI COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il presente tabulato illustra le diverse componenti dei margini iniziali calcolati per il Comparto Obbligazionario e suddivisi per valuta.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS70

Calcolo dei Margini Iniziali MTS							AL	1 MAR 17	MS70	1 MAR 17	19:32:28	Page
GCM	:	GKK										
Aderente:	GKK											
Conto	:	F	Sottoconto:									
MARGINE FINALE												
			Margini di									EUR
DIV		Margini	Mark to		Margini	Cambio	HAIRCUT					Margini
		Ordinari	Market		Iniziali							Iniziali
EUR		3.766.874	3.163.147C		603.727	1,000000						603.727
Totale EUR												603.727

- Il report riporta una tabella in cui, per ogni valuta, è indicato l'importo dei margini calcolati in valuta, l'importo in Euro calcolato tramite tasso di cambio e l'haircut applicato.
- La tabella indica inoltre il totale dei margini in euro.

### 2.4.13 RP-MN13 MAPPATURA MARGINI INIZIALI PAESI SOVRANI

Il presente tabulato contiene i flussi di pagamento al valore di mercato mappati sulle scadenze della curva Paese pertinente per un portafoglio ad una determinata data di valutazione.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MN13

Issuer	Tenor (years)	Net cash flow (mkt)
IE	,25	-0.41
IE	1,00	-1805.81
IE	2,00	-47.09
IE	3,00	99.80
IE	4,00	97.33
IE	5,00	95.11
IE	6,00	3318.36
IE	7,00	1052.15
IE	8,00	-9.69
IE	9,00	-9.29
IE	10,00	-1715.79
IE	15,00	-507.95
PT	,25	-16392.91
PT	,50	-134.65
PT	1,00	-13640.87
PT	2,00	-15411.12
PT	3,00	-14998.10
PT	4,00	-14469.19
PT	5,00	-14021.02
PT	6,00	-13518.88
PT	7,00	-37681.18
PT	8,00	-64693.52
PT	9,00	-9629.17
PT	10,00	-33202.83
PT	15,00	-53635.57
PT	20,00	-174250.50
PT	30,00	-519170.94

## 2.4.14 RP-MN14 MARGINI INIZIALI PAESI SOVRANI- EXPECTED SHORTFALL

Il presente tabulato contiene l'ES della variazione del valore del portafoglio per Paese sovrano ad una determinata data.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MN14

Mbr: GKK	Sov. Price Ini.Margins - Expected Short.	RP-MN14	14 FEB 24	21:09:31	Page 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
Account : C	Evaluation Date: 14/02/2024				
Currency: EUR					
-----					
Issuer	Unscaled ES value	Scaled ES value	ES value		
ES	199.995,69	180.781,05	199.995,66		
IE	276,04	210,68	276,04		
IT	1.556.843,67	1.738.655,32	1.738.655,32		
PT	181.351,75	167.310,43	181.351,75		

## 2.4.15 RP-MS00 RIEPILOGO MARGINI INIZIALI

Il report riporta gli importi dei Margini Iniziali calcolati nei diversi Comparti nei quali il Partecipante opera.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS00

Riepilogo Margini Iniziali		RP-MS00	8 SEP 08	10:21:54	Page 1
Ader: GKK		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA			
Valuta : EURO		Trade Date: 29 JAN 12			
Comparti - Margini	Conto Proprio	Conto Terzi	Report		
AZIONARIO E DERIVATI AZ.-Marg. Ordinari	1.500,00	0,00	MS22		
AZIONARIO E DERIVATI AZ.-Marg. pos. Fail		800,00	0,00	MS27	
DERIVATI ENERGIA-Marg. Ordinari		7.474,18	1.000,00	MSE2	
DERIVATI ENERGIA-Marg. pos. in consegna	85.179,20	0,00	MSE4		
OBBLIGAZIONARIO - Margini Ordinari		700,00	0,00	MS67	
OBBLIGAZIONARIO - Margini pos. Fail		0,00	800,00	MS97	
	-----				
Totale:	95.653,38	1.800,00	MS11		

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Comparti – Margini**" indica il/i Comparto/i di riferimento e la tipologia di Margini Iniziali calcolati;
- le colonne "**Conto Proprio**" e "**Conto Terzi**" riportano gli importi dei Margini Iniziali calcolati in ciascun conto;
- la colonna "**Report**" indica il nome del tabulato di clearing contenente il dettaglio del calcolo dei Margini Iniziali della tipologia specificata;
- la voce "**Totale:**" riporta l'importo complessivo dei Margini Iniziali calcolati in ciascun conto del Partecipante, che sarà indicato anche nel tabulato RP-MS11 alla voce "Margini iniziali".

## 2.4.16 RP-MI00 RIEPILOGO MARGINI INTRADAY

Il report riporta gli importi dei Margini Intraday calcolati nei diversi Comparti nei quali il Partecipante opera.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MI00

Riepilogo Margini Intraday		RP-MI00	8 SEP 08	10:21:54	Page 1
Ader: GKK	CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				
Valuta : EURO	Trade Date: 29 JAN 12				
Comparti - Margini	Conto Proprio	Conto Terzi	Num. / Ora Intraday		
AZIONARIO E DERIVATI AZ.-Marg. Ordinari	1.500,00	0,00	01	16:03:59	
AZIONARIO E DERIVATI AZ.-Marg. pos. Fail	800,00	0,00	01	16:03:59	
DERIVATI ENERGIA-Marg. Ordinari	7.474,18	1.000,00	01	16:03:59	
DERIVATI ENERGIA-Marg. pos. in consegna	85.179,20	0,00	01	16:03:59	
OBBLIGAZIONARIO - Margini Ordinari	700,00	0,00	01	16:03:59	
OBBLIGAZIONARIO - Margini pos. Fail	0,00	800,00	01	16:03:59	
	-----	-----			
Totale:	95.653,38	1.800,00			

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile in seguito ad ogni calcolo dei margini infragionarlieri;
- la colonna "**Comparti - Margini**" indica il/i Comparto/i di riferimento e la tipologia di Margini calcolati (Iniziali o di variazione);
- le colonne "**Conto Proprio**" e "**Conto Terzi**" riportano gli importi dei Margini calcolati in ciascun conto;
- la colonna "**Num. / Ora Intraday**" indica il numero della richiesta intraday e il relativo orario;
- la voce "**Totale:**" riporta l'importo complessivo dei Margini Intraday calcolati in ciascun conto del Partecipante.

## 2.4.17 RP-MS33 MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI

Il tabulato in esame indica l'integrazione richiesta ai Partecipanti interessati a titolo di margini aggiuntivi infragiornalieri da pagare in contanti.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS33

```
Ader: 9999 GKK Intraday Margin Call Report MS33 10 DEC 00 12:56:31
Contrattazioni del: 10 DEC 00

URGENTE----RICHIESTA MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI
Ai sensi dell'articolo B.4.1.3 del Regolamento, CC&G richiede di rendere capiente
il conto PM nel Sistema Target2 tra le ore ..:.. e le ore ..:.. (CET) odierne sul
quale verrà effettuato l'addebito diretto per l'importo di seguito evidenziato.
Aderente: 9999 GKKXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Conto PROPRIO
Ammontare: Euro 16.598.095,00 Ora Rilevazione: 13:05:55
Causale del Versamento: MIF-INF-99999-P
Si segnala che in caso di mancato pagamento entro il termine fissato nella
presente richiesta, il Partecipante sarà dichiarato inadempiente ai sensi
dell'articolo B.6.1.1 del Regolamento.
```

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante Diretto e per ciascun conto segregato (ISA, AOA, GOSA e NOSA);
- nello spazio "**Aderente**" viene indicato il codice alfanumerico del Partecipante e la sua denominazione sociale;
- nello spazio "**Conto**" viene indicato "Proprio" o "Terzi" a seconda che il pagamento richiesto si riferisca all'uno o all'altro conto del Partecipante;
- nello spazio "**Ora rilevazione**" è indicata l'ora di rilevazione delle quotazioni in base alla quale sono stati calcolati i margini aggiuntivi infragiornalieri;
- nello spazio "**Causale del Versamento**" è indicata la causale che Euronext Clearing utilizzerà nel messaggio ASI di addebito del conto PM del Partecipante o del relativo Agente di Regolamento. Dopo la dizione "MIF-INF-" sarà indicato il codice ente e il conto (Proprio o Terzi) del Partecipante per il quale Euronext Clearing effettua l'addebito.

## 2.4.18 RP-MS31 MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI

Il tabulato, prodotto per i soli Partecipanti Diretti che abbiano fatto richiesta di copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri in Strumenti Finanziari e a cui Euronext Clearing richiede Margini Aggiuntivi Infragiornalieri dopo l'orario indicato all'Articolo B.3.1.2, comma 1, lettera c, delle Istruzioni, indica l'ammontare dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri da coprire in Strumenti Finanziari.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS31

Firm: 9999	Intraday Margin Call	RP-MS31	2 NOV 17	14:11:58	Page 1
URGENTE--RICHIESTA MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI					
Ai sensi dell'art B 4.1.3 del Regolamento, CC&G richiede a titolo di margini aggiuntivi infragiornalieri:					
Partecipante: 9999 BNKA SPA Conto: PROPRIO					
Ammontare: Euro 34.010.773,00					
Termine deposito Strumenti Finanziari: 15:45					
Termine addebito in contante in caso di parziale copertura in Strumenti Finanziari: 17:00					
Qualora il deposito degli Strumenti Finanziari non risulti sufficiente a coprire l'ammontare dovuto, CC&G comunica ai soggetti interessati l'ammontare di contante dovuto per il tramite del Report RP-MS32.					
Si segnala che in caso di mancata copertura dei margini aggiuntivi infragiornalieri entro i termini indicati nella presente richiesta, il Partecipante sar... dichiarato inadempiente ai sensi dell'art B 6.1.1 del Regolamento.					

- Il tabulato è prodotto separatamente per il Partecipante Diretto e per ciascun suo eventuale conto segregato (ISA, AOA, GOSA e NOSA) per cui sia stata attivata la richiesta di copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri in Strumenti Finanziari;
- alla voce "**Partecipante**" viene indicata la denominazione e il codice del Partecipante o del conto segregato a cui è riferito il pagamento;
- alla voce "**Conto**" viene indicato il conto "Proprio" o "Terzi" a cui si riferisce la richiesta;
- alla voce "**Ammontare**" è indicato l'ammontare dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri da coprire in Strumenti Finanziari;
- alla voce "**Termine deposito Strumenti Finanziari**" è indicato il termine entro il quale è possibile coprire la richiesta tramite il deposito di titoli di Stato;
- alla voce "**Termine addebito in contante in caso di parziale copertura in Strumenti Finanziari**" è indicato il termine entro il quale è possibile coprire in contanti una eventuale mancata copertura completa dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri da parte degli Strumenti Finanziari depositati.

## 2.4.19 RP-MS32 MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI

Il tabulato, prodotto per i soli Partecipanti Diretti che abbiano fatto richiesta di copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri in Strumenti Finanziari e a cui Euronext Clearing abbia richiesto Margini Aggiuntivi Infragiornalieri dopo l'orario indicato all'Articolo B.3.1.2, comma 1, lettera c, delle Istruzioni, indica se gli Strumenti Finanziari depositati sono o non sono sufficienti a coprire i Margini Aggiuntivi Infragiornalieri richiesti.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS32

Firm: 9999	Intraday Margin Call	RP-MS32	2 NOV 17	17:11:58	Page 1
URGENTE--RICHIESTA MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI					
Si fa seguito alla richiesta di margini aggiuntivi infragiornalieri avanzata con il report MS31 per comunicare che gli strumenti finanziari depositati:					
sono sufficienti a coprire i margini aggiuntivi infragiornalieri.					
Partecipante: 9999 BNKA SPA Conto: PROPRIO					
<i>oppure</i>					
Firm: 9999	Intraday Margin Call	RP-MS32	2 NOV 17	17:11:58	Page 1
URGENTE--RICHIESTA MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI					
Si fa seguito alla richiesta di margini aggiuntivi infragiornalieri avanzata con il report MS31 per comunicare che gli strumenti finanziari depositati:					
non sono sufficienti a coprire i margini aggiuntivi infragiornalieri					
pertanto CC&G richiede di rendere capiente il conto PM nel Sistema Target2 immediatamente e comunque non oltre le ore 17:00 (CET) odierne per l'importo di seguito evidenziato.					
Partecipante: 9999 BNKA Conto: PROPRIO					
Ammontare: Euro 34.010.773,00					
Si segnala che in caso di mancato pagamento entro il termine fissato nella presente richiesta, il Partecipante sarà dichiarato inadempiente ai sensi dell'art B 6.1.1 del Regolamento.					

- Il tabulato è prodotto separatamente per il Partecipante Diretto e per ciascun suo eventuale conto segregato (ISA, AOA, GOSA e NOSA) per cui sia stata attivata la richiesta di copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri in Strumenti Finanziari;
- alla voce "**Partecipante**" viene indicata la denominazione e il codice del Partecipante o del conto segregato a cui è riferito il pagamento;
- alla voce "**Conto**" viene indicato il conto "Proprio" o "Terzi" a cui si riferisce la richiesta;
- alla voce "**Ammontare**" (se presente) è indicato l'ammontare dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri da coprire in contanti entro indicato nello stesso tabulato.

## 2.4.20 RP-MS35 AVVISO DI ADDEBITO MARGINI INTRADAY

Il tabulato riporta tutte le richieste di Margini Aggiuntivi Infragiornalieri inviate nel corso di una stessa giornata all'Agente di Regolamento per conto dei vari Partecipanti per i quali opera.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS35

Bank: BNKA SPA		Avviso di Addebito Margini Intraday			RP-MS35	2 NOV 17	14:05:12	Pag.	1
9999 BNKA		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA							
Richieste del : 2 NOV 17									
Richiesta del 2 NOV 17 H: 11:35									
Mnem	Conto	T.Adese.	Descrizione	Codice	Causale	C.T	Importo	Importo Potenziale	Massimo
BNK1/9999	Client	Diretto	BNK1 SPA	9999	F-INF		20.000.000,00		0,00
							-----	-----	
							20.000.000,00		0,00
Addebito Richiesta H: 11:35 da ore 12:30 a ore 13:30									
Bank: BNKA SPA		Avviso di Addebito Margini Intraday			RP-MS35	16 MAR 11	14:37:12	Pag.	1
9999 BNKA		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA							
Richieste del : 2 NOV 17									
Richiesta del 2 NOV 17 H: 14:36									
Mnem	Conto	T.Adese.	Descrizione	Codice	Causale	C.T	Importo	Importo Potenziale	Massimo
BNK1/9999	Client	Diretto	BNK1 SPA	9999	F-INF		85.963.661,24		0,00
BNK2/1111	Client	Diretto	BNK2 SPA	1111	F-INF	Y*	0,00		10.000.000,00
							-----	-----	
							85.963.661,24		10.000.000,00
Addebito Richiesta H: 14:05 da ore 15:15 a ore 16:15									
* Termine copertura in titoli: 15:00. Successivamente a tale termine, CC&G informa con un ulteriore report MS35 se procederà con l'addebito in contante indicandone in tal caso l'ammontare.									
L'eventuale debito potenziale in contante dovrà essere coperto entro le ore: 16:15									
Bank: BNKA SPA		Avviso di Addebito Margini Intraday			RP-MS35	16 MAR 11	15:30:12	Pag.	1
9999 BNKA		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA							
Richieste del : 2 NOV 17									
Richiesta del 2 NOV 17 H: 14:36									
Mnem	Conto	T.Adese.	Descrizione	Codice	Causale	C.T	Importo	Importo Potenziale	Massimo
BNK2/1111	Client	Diretto	BNK2 SPA	1111	F-INF	Y**	5.000.000,00		0,00
							-----	-----	
							5.000.000,00		0,00
Addebito Richiesta H: 14:05 da ore 15:15 a ore 16:15									
** A seguito della mancata copertura totale in titoli, si procede con l'addebito della richiesta delle ore 14:36 per gli ammontari indicati nella colonna Importo. Si richiede pertanto di rendere immediatamente capiente il conto, la finestra di addebito terminerà alle ore:16:15									

- il tabulato viene prodotto per gli Agenti di Regolamento (del contante);
- alla voce "**Bank**" viene indicata la denominazione sociale dell' Agente di Regolamento e i relativi codici ente e alfanumerico;
- alla voce "**Mnem**" è indicato il codice alfanumerico del Partecipante interessato;
- alla voce "**Conto**" è indicato il conto ("Proprio" o "Terzi") del Partecipante interessato;
- alla voce "**C.T.**", se il campo è valorizzato con "Y", il Partecipante interessato dalla richiesta può depositare titoli di Stato a copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri richiesti;
- alla voce "**Importo**" è indicato l'importo certo che sarà addebitato sul conto PM dell'Agente di Regolamento nell'orario di addebito sotto indicato;
- alla voce "**Importo Potenziale Massimo**" è indicato l'importo potenziale massimo addebitabile sul conto PM dell'Agente di Regolamento per tutte le richieste di Margini Aggiuntivi Infragiornalieri relative ai Partecipanti autorizzati alla copertura in Strumenti Finanziari. L'Agente di Regolamento sarà tenuto a coprire al massimo questo ammontare nel caso in cui tali Partecipanti non depositino nei termini previsti titoli di Stato a copertura dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri richiesti.

## 2.4.21 RP-MS36 INTRADAY - IMPORTI GCM/NCM

Il tabulato in esame riporta tutte le richieste di Margini Aggiuntivi Infragiornalieri inviate nel corso di una stessa giornata al Partecipante Diretto con il dettaglio dei Margini Iniziali calcolati per suo conto e per conto di ciascuno dei suoi eventuali Clienti Negoziatori.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS36

		Intraday - Importi GCM/NCM		RP-MS36	24 MAR 11	13:01:21	Pag.	1
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
		situazione al : 22 Feb 11						
GCM : GENERAL GROUP SA								
1133 AAAA								
GCM ----- Member -----								
Req	Conto	Mnem/MBR	Conto	Descrizione	Tot Margin			
1	Proprio	AAAA/1133	Proprio	GENERAL GRUP SA	78.727.497,71			
					-----	Asset Value	Amount Requested	
Tot. Account F					78.727.497,71	50.000.000,00	28.727.497,71	
GCM ----- Member -----								
Req	Conto	Mnem/MBR	Conto	Descrizione	Tot Margin			
1	Terzi	AABB/1122	Proprio	ABABI S.A	72.717.453,79			
1	Terzi	CCDD/3344	Proprio	CADICO S.A.	540.415,00			
1	Terzi	CCDD/5566	Terzi	CADICO S.A.	6.135.240,13			
1	Terzi	AAAA/1111	Terzi	GENERAL GROUP SA	54.216.840,83			
1	Terzi	GGHH/1212	Terzi	GACICO GROUP LTD	119.255,68			
1	Terzi	IILL/1313	Proprio	ILIL SA	3.988.982,44			
1	Terzi	MMNN/1414	Proprio	MINI GRP LTD	5.512.765,95			
					-----	Asset Value	Amount Requested	
Tot. Account C					143.230.953,82	132.621.190,00	10.609.763,82	
GCM ----- Member -----								
Req	Conto	Mnem/MBR	Conto	Descrizione	Tot Margin			
2	Terzi	AABB/1122	Proprio	ABABI S.A	76.353.326,48			
2	Terzi	CCDD/3344	Proprio	CADICO S.A.	567.435,75			
2	Terzi	CCDD/5566	Terzi	CADICO S.A.	6.442.002,14			
2	Terzi	AAAA/1111	Terzi	GENERAL GROUP SA	56.927.682,87			
2	Terzi	GGHH/1212	Terzi	GACICO GROUP LTD	125.218,47			
2	Terzi	IILL/1313	Proprio	ILIL SA	4.188.431,56			
2	Terzi	MMNN/1414	Proprio	MINI GRP LTD	5.788.404,24			
					-----	Asset Value	Amount Requested	
Tot. Account C					150.392.501,51	143.230.953,82	7.161.547,69	

- Il tabulato viene prodotto per i Partecipanti Diretti e per ciascun conto segregato (ISA, AOA, GOSA e NOSA);
- nello spazio "**GCM**" viene indicata la denominazione sociale del Partecipante Diretto e i relativi codici ente e alfanumerico;
- nello spazio "**Req**" viene indicato il numero della richiesta infragiornaliera (tenuto conto che nel corso di una stessa giornata Euronext Clearing potrebbe inviare più di una richiesta di Margini Aggiuntivi Infragiornalieri );
- nello spazio "**Mnem**" è indicato il codice alfanumerico del Partecipante;
- nello spazio "**Conto**" è indicato il Conto (Proprio o Terzi) del Partecipante;
- nello spazio "**Tot Margin**" viene indicato l'ammontare degli importi a debito (Margini Iniziali, Margini di Variazione, Premi) calcolati per ciascun conto del Partecipante Diretto e dei suoi eventuali Clienti Negoziatori.
- nello spazio "**Tot Account F**" è indicato l'ammontare degli importi a debito (Margini Iniziali, Margini di Variazione, Premi) calcolati per il conto Proprio del Partecipante Diretto; tale ammontare non tiene conto delle garanzie disponibili (Asset Value) e pertanto non rappresenta l'importo dei Margini Infragiornalieri effettivamente addebitato al Partecipante (indicato alla voce Amount Requested);
- nello spazio "**Tot. Account C**" è indicato l'ammontare totale dei degli importi a debito (Margini Iniziali, Margini di Variazione, Premi) calcolati per il conto Terzi (committenti) del Partecipante Diretto e per ciascun conto (Proprio e Terzi) dei suoi eventuali Clienti Negoziatori; tale ammontare non tiene conto delle garanzie disponibili (Asset Value) e pertanto non rappresenta l'importo dei Margini Infragiornalieri effettivamente addebitato al Partecipante Diretto (indicato alla voce Amount Requested);
- nello spazio "**Asset Value**" viene indicato il valore delle garanzie disponibili del Partecipante Diretto;
- nello spazio "**Amount Requested**" viene indicato l'importo dei Margini Aggiuntivi Infragiornalieri richiesto al Partecipante Diretto per il conto specificato.

## 2.4.22 RP-MS14 DEFAULT FUND: SINTESI MENSILE

Il tabulato riporta i parametri di calcolo e l'importo della contribuzione al Default Fund a carico del Partecipante.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS14

Ader: GKK		DEFAULT FUND: sintesi mensile			MS14	6 NOV 02	18:07:56	Pag.
1								
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
		MDF/DEFAULT FUND (DER/MTA)						
		Contribuzione DEFAULT FUND						
Mbr	Totale	Medie	Quota	Calcolata	QUOTA	DOVUTA	Quota	Variazione
							precedente	
0001	GKK	65.051.819,77	4.592.850,10	4.593.000,00	4.593.000,00	2.907.000,00	1.686.000,00	
0002	AA	463.061,48	32.693,50	50.000,00	50.000,00	50.000,00	,00	
TOTAL:		65.514.881,25		4.643.000,00	4.643.000,00	2.957.000,00	1.686.000,00	
Periodo Osservazione . . . . . :		01 JUN 05 --> 30 JUN 05						

- il tabulato viene prodotto periodicamente per tutti i Partecipanti Diretti ed è disponibile la mattina dell'inizio di ogni periodo;
- per i Partecipanti Generali, viene evidenziato anche il dettaglio dei Clienti Negoziatori (cfr. Mbr 0002 AA);
- l'importo della contribuzione viene riportato nel messaggio M01 di Rete Interbancaria RNI, insieme alla situazione finanziaria del Partecipante e nel messaggio M03 (Rendicontazione giornaliera dei pagamenti a Euronext Clearing).

### 2.4.23 RP-MS15 DEFAULT FUND: DETTAGLIO CALCOLO

Il tabulato riporta i parametri di calcolo e l'importo della contribuzione al Default Fund a carico del Partecipante.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS15

Ader: GKK				DEFAULT FUND: dettaglio calcolo				RP-MS15				6 NOV 02 18:07:56 Pag. 1			
				CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA											
				MDF/DEFAULT FUND (DER/MTA)											
Val.: EURO				Periodo riferimento				1 JUN 05 --> 30 JUN 05							
Data		Margine C/PROPRIO		Margine C/TERZI		Margine TOTALE									
01 JUN 05		147.579,49		530.537,71		678.117,20									
02 JUN 05		182.421,40		470.520,21		652.941,61									
03 JUN 05		227.849,63		416.936,43		644.786,06									
06 JUN 05		186.584,31		194.481,70		381.066,01									
07 JUN 05		196.502,24		394.325,21		590.827,45									
08 JUN 05		312.524,29		646.498,02		959.022,31									
09 JUN 05		549.519,86		1.152.509,64		1.702.029,50									
10 JUN 05		394.853,12		1.498.344,17		1.893.197,29									
13 JUN 05		353.667,15		1.317.066,21		1.670.733,36									
14 JUN 05		114.102,09		1.511.686,07		1.625.788,16									
15 JUN 05		,00		1.219.051,63		1.219.051,63									
16 JUN 05		,00		1.651.480,77		1.651.480,77									
17 JUN 05		,00		1.181.354,97		1.181.354,97									
20 JUN 05		13.639,11		811.350,08		824.989,19									
21 JUN 05		123.179,47		385.121,00		508.300,47									
22 JUN 05		199.234,36		566.263,80		765.498,16									
23 JUN 05		186.996,55		657.215,48		844.212,03									
24 JUN 05		181.768,94		724.497,96		906.266,90									
27 JUN 05		190.703,89		477.191,99		667.895,88									
28 JUN 05		90.936,91		423.024,04		513.960,95									
29 JUN 05		163.422,31		617.159,74		780.582,05									
30 JUN 05		204.500,68		464.609,43		669.110,11									
RIEPILOGO															
Margine	:	4.019.985,80		17.311.226,26		21.331.212,06									
Media	:	182.726,62		786.873,92		969.600,54									
TOT. Medie Members	:					2.124.557.245,02									
Quota calcolata	:					68.456,65									
Quota di competenza:						68.000,00									
Giorni 03/MTA	:		22		22										
* FINE LISTA *															

- il tabulato viene prodotto periodicamente per tutti i Partecipanti ed è disponibile la mattina dell'inizio di ogni periodo;
- gli importi relativi alla quota calcolata e alla quota di competenza sono riportati anche nel tabulato RP-MS14.

## 2.4.24 RP-MMDF VARIAZIONE DEFAULT FUND COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato è utilizzato da Euronext Clearing per comunicare le variazioni del Default Fund relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MMDF

Ader.: BAUN BANCA UNO SPA	VARIAZIONE DEFAULT FUND	RP-MMDF	16 FEB 18	13:06:09 Pag. 1
Valuta: EUR - EURO				
Default Fund Comparto/i:	Azionario e Derivati Azionari			
Data variazione e regolamento Quote di Contribuzione:	19/02/2018			
Causale di pagamento:	BOR-MDF			
Variazione ammontare Default Fund:	SI [1]	Da Euro: 1.200.000.000,00	A Euro: 1.300.000.000,00	
Nella stessa giornata del 19/02/2018:				
- nel menu Default Fund della ICWS e per il tramite del messaggio M01 sulla RNI sarà segnalata la variazione delle Quote di Contribuzione;				
- i Partecipanti debitori o i relativi Agenti di Regolamento dovranno rendere capiente il proprio Conto PM nel Sistema TARGET2 affinché CC&G possa provvedere all'addebito diretto delle somme dovute [2] (il periodo di addebito inizierà alle ore 9:00 e terminerà alle ore 9:30 [3]);				
- CC&G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento [2].				
Note:				
[1] Sul sito Internet di CC&G <a href="http://www.lseg.com/ccg">www.lseg.com/ccg</a> sono disponibili le seguenti informazioni:				
- alla sezione "Risk Management - Default Fund Parameters", l'ammontare del Default Fund e gli altri parametri utilizzati per il calcolo delle Quote di Contribuzione;				
- alla sezione "Risk Management", le modalità di calcolo delle Quote di Contribuzione.				
[2] Utilizzando la procedura ancillare n.3 (c.d. Bilateral Settlement).				
[3] Gli importi in addebito saranno notificati da CC&G al Partecipante Diretto o al relativo Agente di Regolamento mediante:				
- i Report MS14, MS53 e MS52;				
- il "preavviso di pagamento" inviato nel Sistema TARGET2 via ICM alle ore 7:45;				
- qualora attivata, la "Rendicontazione giornaliera dei pagamenti" (messaggi M03 via RNI e messaggi MT298 via SWIFT).				

- il tabulato viene prodotto ed inviato ai Partecipanti Diretti nel corso della giornata lavorativa precedente quella di variazione e regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund;
- alla voce **"Data variazione e regolamento Quote di Contribuzione"** è indicata la data di variazione e di regolamento delle Quote di Contribuzione;
- Alla voce **"Variazione ammontare Default Fund"** è indicato **"SI"** o **"NO"** a seconda che l'ammontare del Default Fund sarà modificato o lasciato invariato; se il valore sarà **"NO"**, il ricalcolo delle Quote di Contribuzione sarà effettuato sulla base dell'attuale ammontare del Default Fund;
- Alle voci **"Da Euro"** e **"A Euro"** sarà indicato l'ammontare del Default Fund prima e dopo l'eventuale variazione; se l'ammontare del Default Fund resterà invariato, tali voci non saranno valorizzate;
- Alla voce **"Nella stessa giornata del"** sarà indicata la data (sempre corrispondente alla "Data di variazione e regolamento delle Quote di Contribuzione") in cui si svolgeranno le attività indicate nella parte successiva del Report.

## 2.4.25 RP-MMMT VARIAZIONE DEFAULT FUND COMPARTI OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato è utilizzato da Euronext Clearing per comunicare le variazioni del Default Fund relativo ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MMMT

Ader.: BAUN BANCA UNO SPA	VARIAZIONE DEFAULT FUND	RP-MMMT	16 FEB 18	13:06:09 Pag. 1
Valuta: EUR - EURO				
Default Fund Comparto/i:	Obbligazionario, Obbligazionario ICSD e X-COM			
Data variazione e regolamento Quote di Contribuzione:	19/02/2018			
Causale di pagamento:	BOR-MMT			
Variazione ammontare Default Fund:	SI [1]	Da Euro: 3.800.000.000,00	A Euro: 3.900.000.000,00	
Nella stessa giornata del 19/02/2018:				
<ul style="list-style-type: none"> <li>- nel menu Default Fund della ICWS e per il tramite del messaggio M01 sulla RNI sarà segnalata la variazione delle Quote di Contribuzione;</li> <li>- i Partecipanti debitori o i relativi Agenti di Regolamento dovranno rendere capiente il proprio Conto PM nel Sistema TARGET2 affinché CC&amp;G possa provvedere all'addebito diretto delle somme dovute [2] (il periodo di addebito inizierà alle ore 9:00 e terminerà alle ore 9:30 [3]);</li> <li>- CC&amp;G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento [2].</li> </ul>				
Note:				
<p>[1] Sul sito Internet di CC&amp;G <a href="http://www.lseg.com/ccg">www.lseg.com/ccg</a> sono disponibili le seguenti informazioni:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- alla sezione "Risk Management - Default Fund Parameters", l'ammontare del Default Fund e gli altri parametri utilizzati per il calcolo delle Quote di Contribuzione;</li> <li>- alla sezione "Risk Management", le modalità di calcolo delle Quote di Contribuzione.</li> </ul>				
<p>[2] Utilizzando la procedura ancillare n.3 (c.d. Bilateral Settlement).</p>				
<p>[3] Gli importi in addebito saranno notificati da CC&amp;G al Partecipante Diretto o al relativo Agente di Regolamento mediante:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- i Report MS14, MS53 e MS52;</li> <li>- il "preavviso di pagamento" inviato nel Sistema TARGET2 via ICM alle ore 7:45;</li> <li>- qualora attivata, la "Rendicontazione giornaliera dei pagamenti" (messaggi M03 via RNI e messaggi MT298 via SWIFT).</li> </ul>				

- il tabulato viene prodotto ed inviato ai Partecipanti Diretti nel corso della giornata lavorativa precedente quella di variazione e regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund;
- alla voce **"Data variazione e regolamento Quote di Contribuzione"** è indicata la data di variazione e di regolamento delle Quote di Contribuzione;
- Alla voce **"Variazione ammontare Default Fund"** è indicato **"SI"** o **"NO"** a seconda che l'ammontare del Default Fund sarà modificato o lasciato invariato; se il valore sarà **"NO"**, il ricalcolo delle Quote di Contribuzione sarà effettuato sulla base dell'attuale ammontare del Default Fund;
- Alle voci **"Da Euro"** e **"A Euro"** sarà indicato l'ammontare del Default Fund prima e dopo l'eventuale variazione; se l'ammontare del Default Fund resterà invariato, tali voci non saranno valorizzate;
- Alla voce **"Nella stessa giornata del"** sarà indicata la data (sempre corrispondente alla "Data di variazione e regolamento delle Quote di Contribuzione") in cui si svolgeranno le attività indicate nella parte successiva del Report.

## 2.5 Sezione V: Interessi e Commissioni

Questa sezione descrive i tabulati degli interessi maturati e delle commissioni.

### 2.5.1 RP-MS05 INTERESSI MENSILI MATURATI

Il tabulato riporta l'importo degli interessi maturati nel corso dell'ultimo mese sul contante depositato per i margini, con il dettaglio giornaliero.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS05

Ader: xxxxxxxxxxxx		Interessi Mensili Maturati		RP-MS05	9 DEC 14	17:11:51	Pag 1
Conto: PROPRIO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		Periodo dal 01 NOV 14 al 30 NOV 14			
		Accumulati	Tasso	Interessi	Tasso	Interessi	Tasso
Interessi	Saldo	Interessi					
Data							
EUR - EURO							
1 NOV 14	100.183,00	0,19-	0,06800-				
2 NOV 14	100.183,00	0,19-	0,06800-				
3 NOV 14	1.779.300,00	9,14-	0,18500-				
4 NOV 14	455.205,00	2,39-	0,18900-				
5 NOV 14	554.597,00	2,96-	0,19200-				
6 NOV 14	342.755,00	1,78-	0,18700-				
7 NOV 14	250.772,00	1,31-	0,18800-				
8 NOV 14	250.772,00	1,31-	0,18800-				
9 NOV 14	250.772,00	1,31-	0,18800-				
10 NOV 14	1.121.994,00	5,67-	0,18200-				
11 NOV 14	44.979,00	0,23-	0,18600-				
12 NOV 14	59.979,00	0,29-	0,17700-				
13 NOV 14	14.946,00	0,07-	0,17800-				
14 NOV 14	14.964,00	0,07-	0,17900-				
15 NOV 14	14.964,00	0,07-	0,17900-				
16 NOV 14	14.964,00	0,07-	0,17900-				
17 NOV 14	76.619,00	0,38-	0,17700-				
18 NOV 14	1.024.834,00	4,90-	0,17200-				
19 NOV 14	841.734,00	4,04-	0,17300-				
20 NOV 14	134.914,00	0,63-	0,16900-				
21 NOV 14	1.201.094,00	5,37-	0,16100-				
22 NOV 14	1.201.094,00	5,37-	0,16100-				
23 NOV 14	1.201.094,00	5,37-	0,16100-				
24 NOV 14	396.148,00	1,72-	0,15600-				
25 NOV 14	391.334,00	1,45-	0,13300-				
26 NOV 14	6.034.845,00	17,43-	0,10400-				
27 NOV 14	6.017.271,00	20,22-	0,12100-				
28 NOV 14	580.096,00	0,35-	0,02200-				
29 NOV 14	580.096,00	0,35-	0,02200-				
30 NOV 14	580.096,00	0,35-	0,02200-				
TOTALI:		94,98-					

- il tabulato viene prodotto per i soli Partecipanti Generali e Partecipanti Individuali ed è disponibile i primi giorni del mese successivo a quello di riferimento;
- gli interessi maturati vengono liquidati trimestralmente;
- la colonna "**Saldo**" indica per ciascun giorno l'ammontare totale del contante depositato;
- l'importo totale degli interessi indicato alla fine della colonna "**Interessi Accumulati**" è riportato anche nel tabulato RP-MS11.

## 2.5.2 RP-MF40 COMMISSIONI GIORNALIERE DI RETTIFICA

Il tabulato, disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni, è prodotto per i Partecipanti Diretti, i conti segregati (ISA, AOA, GOSA e NOSA) e i Clienti Negoziatori ed indica le commissioni relative alle rettifiche di posizioni lorde Futures ed Options in conto Terzi eseguite nella giornata di riferimento.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MF40

Ader: BANI BANCA UNO SPA		Commissioni giornaliera di rettifica CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Operazioni del 06 NOV 18				RP-MF40	6 NOV 18	21:41:04	Pag. 1
Valuta : EUR - EURO		O/C disponibile		Rettifiche posizioni		Tipo	Orario	Commissione	
Conto : Terzi		Tot.Open	Tot.Close	Diminuzione	Aumento	Commissione	Operazione	Euro	
Sottoconto : *OMN		-----							
Tipo	Serie								
F	FCA8K	0	2	0	2	W	09:12:10	0,00	
F	FCA8K	0	0	0	1	W	10:05:45	0,25	
F	FCA8K	0	0	1	0	W	16:15:00	0,25	
							Tot.Serie :	0,50	
F	FDIV8L	10	8	5	0	W	09:14:25	0,00	
F	FDIV8L	5	8	7	0	W	09:25:54	0,50	
F	FDIV8L	0	8	1	0	W	10:12:21	0,25	
F	FDIV8L	0	8	0	4	W	10:15:10	0,00	
F	FDIV8L	0	4	0	5	W	11:08:41	0,25	
F	FDIV8L	0	0	0	2	W	12:41:20	0,50	
F	FDIV8L	0	0	1	0	W	14:15:01	0,25	
							Tot.Serie :	1,75	
F	FIB8L	6	0	0	6	0	0	0,00	
F	FIB8L	0	0	2	3	0	0	0,50	
F	FIB8L	0	0	0	3	0	0	0,75	
							Tot.Serie :	1,25	
F	MINI8L	4	2	5	0	W	11:01:35	0,25	
F	MINI8L	0	2	0	1	W	11:15:05	0,00	
F	MINI8L	0	1	0	1	W	12:32:44	0,25	
F	MINI8L	0	0	0	1	W	13:00:45	0,25	
							Tot.Serie :	0,75	
O	BC8W26	0	0	2	0	W	10:01:24	0,50	
							Tot.Serie :	0,50	
O	BMED8X5.80	0	0	0	4	W	18:14:11	1,00	
							Tot.Serie :	1,00	
O	MIBO2W8K19700	0	0	1	0	W	11:02:05	0,25	
							Tot.Serie :	0,25	
O	PRY8L17	0	0	2	0	W	18:01:59	0,50	
							Tot.Serie :	0,50	
							-----	-----	
							TOTALE :	6,50	

- la colonna "**Type**" indica il tipo di prodotto derivato (**F**=Futures; **O**= Options) interessato dalla rettifica di posizioni;
- la voce "**O/C disponibile**" indica il numero di posizioni rettificabili gratuitamente in aumento e in diminuzione al momento di esecuzione della rettifica; la colonna "**Tot. Open**" indica il numero di posizioni rettificabile gratuitamente in diminuzione, mentre la colonna "**Tot. Close**" indica il numero di posizioni rettificabile gratuitamente in aumento;
- la voce "**Rettifiche di posizioni**" indica il numero di posizioni rettificate in diminuzione o in aumento;

- la colonna "**Tipo Commissione**" indica il tipo di commissione applicata all'operazione: "**W**" = commissione standard; "**M**" = commissione amministrativa; la commissione standard sarà pari a zero se relativa a rettifica di posizioni Futures eseguita entro l'orario di gratuità (ore **13:00**) su posizioni aperte nel corso del giorno lavorativo precedente.

### 2.5.3 RP-MT36 RIEPILOGO SERVIZI ADDEBITATI

Il tabulato indica i servizi addebitati nel corso del mese precedente, da liquidarsi il primo giorno lavorativo del mese corrente.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT36

Ader: GKK BANCA GKK Riepilogo Servizi Addebitati RP-MT36 31 JAN 07 21:19:46 Pag. 1							
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA							
Periodo riferimento 01/2007							
	Servizio	Canone	Iva %	Importo Iva	Canone addebitato	Conto	
GKK	GKK BANCA GKK						
	BCS-GCM - PRIMARIA	350,00	,00%	,00	350,00	P	
	BCS-GCM - PRIMARIA	350,00	,00%	,00	350,00	P	
	BCS-GCM - ADDIZIONALE	100,00	,00%	,00	100,00	P	
	BCS-GCM - ADDIZIONALE	100,00	,00%	,00	100,00	P	
	BCS-API - PRIMARIA	120,00	20,00%	24,00	144,00	P	
	BCS-API - PRIMARIA	120,00	20,00%	24,00	144,00	P	
	REPORT - MARGIN.NE I	500,00	20,00%	100,00	600,00	P	
	SOTTOCONTI- SOTTOCONTI	400,00	20,00%	80,00	480,00	P	
	<b>Totale MEMBER:</b>	<b>2.040,00</b>		<b>228,00</b>	<b>2.268,00</b>		
AXIO	AXIO SIM S.P.A.						
	ICWS BASIC- ADDIZIONALE	100,00	,00%	,00	100,00	T	
	ICWS BASIC- PRIMARIA	150,00	,00%	,00	150,00	T	
	ICWS BASIC- PRIMARIA	150,00	,00%	,00	150,00	T	
	<b>Totale MEMBER:</b>	<b>400,00</b>		<b>,00</b>	<b>400,00</b>		
	<b>Totale C/TERZI:</b>	<b>400,00</b>		<b>,00</b>	<b>400,00</b>		
	<b>Totale C/PROPRIO:</b>	<b>2.040,00</b>		<b>228,00</b>	<b>2.268,00</b>		
	<b>Totale GCM:</b>	<b>2.440,00</b>		<b>228,00</b>	<b>2.668,00</b>		

- Il tabulato viene prodotto per i Partecipanti Diretti ed è disponibile il primo giorno del mese successivo a quello di riferimento; per i Partecipanti Generali, il tabulato riporta anche gli importi dovuti per conto di ciascun Cliente Negoziatore.
- la colonna "**Servizio**" contiene il tipo di servizio addebitato: BCS-GCM (BCS-WS Partecipante Generale), BCS-ICM (BCS-WS Partecipante Individuale), BCS-NCM (BCS-WS Cliente Negoziatore), BCS-API (BCS Application Program Interface), ICWS basic, REPORT

e SOTTOCONTI (addebito per ciascun sottoconto attivato dal Partecipante);

- la colonna "**Canone**" contiene il canone, IVA esclusa, applicato al servizio;
- la colonna "**Iva%**" contiene la percentuale IVA applicata al canone;
- la colonna "**Importo Iva**" contiene il controvalore in euro dell'IVA applicata al canone;
- la colonna "**Canone addebitato**" contiene il canone, IVA inclusa, addebitato per il servizio;
- la colonna "**Conto**" indica il conto di competenza di ciascun canone addebitato; gli importi riferiti ai Partecipanti Diretti sono attribuiti alle competenze del Conto Proprio (P), mentre quelli riferiti ai Clienti Negoziatori, sono attribuiti alle competenze del Conto Terzi (T) del Partecipante Generale.

## 2.5.4 RP-MT37 ELENCO DEI SERVIZI SOTTOSCRITTI

Il tabulato riporta l'elenco dei servizi sottoscritti dal Partecipante ed il relativo canone dovuto (con riferimento al mese precedente) da liquidarsi il primo giorno lavorativo del mese corrente.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT37

Ader: GKK BANCA GKK Elenco dei Servizi Sottoscritti RP-MT37 31 JAN 07 21:19:48 Pag. 1						
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Periodo riferimento 01/2007						
Servizio	Canone	Iva %	Importo Iva	Canone addebitato	Conto	
BCS-GCM - PRIMARIA	350,00	,00%	,00	350,00	P	
BCS-GCM - PRIMARIA	350,00	,00%	,00	350,00	P	
BCS-GCM - ADDIZIONALE	100,00	,00%	,00	100,00	P	
BCS-GCM - ADDIZIONALE	100,00	,00%	,00	100,00	P	
BCS-API - PRIMARIA	120,00	20,00%	24,00	144,00	P	
BCS-API - PRIMARIA	120,00	20,00%	24,00	144,00	P	
REPORT - MARGIN.NE I	500,00	20,00%	100,00	600,00	P	
SOTTOCONTI- SOTTOCONTI	400,00	20,00%	80,00	480,00	P	
Totale MEMBER . . . :	2.040,00		228,00	2.268,00		

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile il primo giorno del mese successivo a quello di riferimento;
- la colonna "**Servizio**" contiene il tipo di servizio addebitato: BCS-GCM (BCS-WS Partecipante Generale), BCS-ICM (BCS-WS Partecipante Individuale), BCS-NCM (BCS-WS Cliente Negoziatore), BCS-API (BCS Application Program Interface, ICWS basic, , REPORT e SOTTOCONTI (addebito per ciascun sottoconto attivato dal Partecipante);
- la colonna "**Canone**" contiene il canone applicato al servizio, IVA esclusa;
- la colonna "**Iva%**" contiene la percentuale IVA applicata al canone;
- la colonna "**Importo Iva**" contiene il controvalore in euro dell'IVA applicata al canone;
- la colonna "**Canone addebitato**" contiene il canone addebitato per il servizio, IVA compresa;
- la colonna "**Conto**" indica il conto di competenza (P= Proprio; T= Terzi) del canone addebitato;

## 2.5.5 RP-MT48 COMMISSIONI MENSILI ACCUMULATE

Il tabulato indica le commissioni maturate nel corso del mese precedente, da liquidarsi il primo giorno lavorativo del mese corrente.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT48

Ader: GKK		Addebito Mensile Commissioni			RP-MT48	6 JAN 03	16:06:10	Page 1
Conto: PROPRIO *OMN		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA			Da: 01 JAN 03 A: 31 JAN 03			
		Commissioni Clearing	Commissioni Dispositive	Commissioni Set/Esercizio	Comm.Ritardo Depos. Titoli	Commissioni diverse	Importo	
02 JAN 03	AZA07 V	0,18	,00	,00			0,18	
	ENI C	60,00	,00	,00			60,00	
	SEMIB F	120,38	54,00	,00			174,38	
	SEMIB O	,41	,00	,00			,41	
Totale:		180,87	54,00	,00	,00	,00	234,87	
03 JAN 03	ENEL F	140,00	,00	,00			140,00	
	ENI C	2,00	,00	,00			2,00	
	MIB30 F	191,62	126,00	,00			317,62	
	TIS O	,00	600,00	,00			600,00	
	WEDN W	,18	,00	,00			,18	
Totale:		333,80	726,00	,00	,00	,00	1.059,80	
06 JAN 03	ENEL O	27,00	,00	,00			27,00	
	MIB30 F	230,62	72,00	,00			302,62	
	MM30 F	,16	,00	,00			,16	
	SPI O	3,30	,00	,00			3,30	
	TI FAIL	,40	,00	,00			,40	
	TIM O	1,80	,00	,00			1,80	
	TIS O	,00	600,00	,00			600,00	
	BCS/WS					1.300,00		
	BCS/API					288,00*		
	REPORT					300,00*		
	SUBACC					400,00*		
263,28	672,00	,00	,00	1.888,00	935,28			
Totale Valuta :		778,05	1.452,00	,00	,00	1.888,00	4.118,05	

(\*) Comprensivo di IVA

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile il primo giorno del mese successivo a quello di riferimento;
- la colonna "**Commissioni di clearing**" contiene, raggruppate per data, le commissioni relative ai vari prodotti e servizi, dei quali nella colonna di sinistra è indicato mediante simbolo la natura ("O" = Options, "F" = Futures, "C" = Azioni o ETF, "V" = Obbligazioni convertibili, "W" = "Warrant, "FAIL" = Posizioni in fail, ecc.)
- la colonna "**Commissioni Dispositive**" contiene, raggruppate per data, le commissioni relative alle funzioni dispositive inoltrate per tramite della BCS oppure manualmente via fax;
- la colonna "**Commissioni Set/Esercizio**" indica le commissioni dovute a fronte delle posizioni contrattuali esercitate/assegnate e agli stock futures in consegna/ritiro;
- la colonna "**Comm.Ritardo/ Depos. Titoli**" indica le commissioni su ritardati pagamenti e quelle dovute a copertura dei costi di gestione dei titoli costituiti a garanzia;

- la colonna "**Commissioni diverse**" contiene la quota annuale di adesione (MBRSHIP) ed i canoni mensili (i cui dettagli sono indicati nel report RP-MT36 e RP-MT37) dei seguenti servizi: BCS Work Station (BCS/WS), BCS Application Program Interface (BCS/API), ICWS basic, REPORT e SUBACC (addebito per ciascun sottoconto attivato dal Partecipante).
- L'asterisco indica che gli importi sono comprensivi di IVA.
- il giorno di liquidazione, gli importi da regolare vengono riportati nel tabulato RP-MS11.
- le informazioni relative alle commissioni sulle posizioni in fail sono riportate nel tabulato MT47.

## 2.5.6 RP-MT47 COMMISSIONI FAIL ACCUMULATE

Il tabulato indica il dettaglio delle commissioni relative alle posizioni in fail maturate nel corso del mese precedente, da liquidarsi il primo giorno lavorativo del mese corrente.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MT47

Ader: GKK		Commissioni Fails					RP-MT47	30 JUN 05	22:08:23	Page
(Comparti Azionario e Derivati Azionari)										
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA										
DA: 01 JUN 05 A: 30 JUN 05										
Conto: Proprio										
Data	ID				Data	Data				
Riferim	CC&G	Simbolo	Titolo	ISIN	Regolam	Scadenza	Quantita'	Controvalore	Fees	
21 JUN 05	UF35HY	TOD	TOD'S	IT0003007728	21 JUN 05	30 JUN 05	332	13.742,75	50,00	Fail
22 JUN 05	UF35HY	TOD	TOD'S	IT0003007728	21 JUN 05	30 JUN 05	332	13.742,75	50,00	Fail
23 JUN 05	4DDL7	ENI	ENI	IT0003132476	23 JUN 05	04 JUL 05	92.857	1.991.817,50	200,00	Fail
23 JUN 05	4DDJAY	ENI	ENI	IT0003132476	23 JUN 05	04 JUL 05	93.238	1.999.990,08	200,00	Fail
28 JUN 05	9YWW70	LIT	LOTTOMATICA	IT0003380919	28 JUN 05	07 JUL 05	537	14.687,17	50,00	Fail
30 JUN 05	YWGG2U	TOD	TOD'S	IT0003007728	30 JUN 05	11 JUL 05	6.158	243.533,33	150,00	Fail
									Totale	5.450,00

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile il primo giorno del mese successivo a quello di riferimento;
- la colonna "data di riferimento" indica la data in cui è stata applicata la commissione;
- la colonna "ID Euronext Clearing" indica il numero univoco identificativo del fail.

## 2.5.7 RP-MFM4 COMMISSIONI OBBLIGAZIONARIO RETAIL

Il tabulato indica il dettaglio delle commissioni relative alle posizioni del comparto Obbligazionario Retail maturate nel corso del mese precedente, da liquidarsi il primo giorno lavorativo del mese corrente.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MFM4

Mor: GKK		Commissioni Obbligazionario Retail		RP-MFM4	06 JAN 14	10:29:56	Pag: 1
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
Conto: TERZI		Da 01 DEC 13		a 31 DEC 13			
Data	Provenienza	Simbolo	ID Commissione	Importo Commissione	Valuta		
2/12/2013	MOT	BTI	Clearing Fees	3,68	EUR		
2/12/2013	MOT	BTP	Clearing Fees	7,59	EUR		
2/12/2013	MOT	OCT	Clearing Fees	0,23	EUR		
2/12/2013	MOT	MOT	Clearing Fees	13,80	EUR		
2/12/2013	TLX	BTI	Clearing Fees	0,46	EUR		
2/12/2013	TLX	BTP	Clearing Fees	0,69	EUR		
3/12/2013	MOT	BTI	Clearing Fees	3,91	EUR		
3/12/2013	MOT	BTP	Clearing Fees	7,59	EUR		
Tot Conto: TERZI				38,18			
Conto: PROPRIO							
2/12/2013	MOT	BTI	Clearing Fees	7,82	EUR		
2/12/2013	MOT	OCT	Clearing Fees	0,92	EUR		
2/12/2013	MOT	MOT	Clearing Fees	15,64	EUR		
2/12/2013	TLX	MOT	Clearing Fees	0,92	EUR		
3/12/2013	MOT	BTI	Clearing Fees	4,14	EUR		
3/12/2013	MOT	BTP	Clearing Fees	37,26	EUR		
3/12/2013	MOT	OCT	Clearing Fees	9,66	EUR		
30/12/2013	MOT	MOT	Clearing Fees	11,27	EUR		
30/12/2013	TLX	MOT	Clearing Fees	1,38	EUR		
Tot Conto: PROPRIO				89,01			
<hr/>							
PROVENIENZA				TOTALI			
PROVENIENZA				TOTALI			
MOT				123,74			
TLX				3,45			
Totale Commissioni:				127,19			

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Obbligazionario ed è disponibile il primo giorno del mese successivo a quello di riferimento;
- la colonna "data" indica la data in cui è stata applicata la commissione.

## 2.5.8 RP-MFM6 COMMISSIONI OBBLIGAZIONARIO WHOLESALE

Il tabulato indica il dettaglio delle commissioni relative alle posizioni del comparto Obbligazionario Wholesale maturate nel corso del mese precedente, da liquidarsi il primo giorno lavorativo del mese corrente.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MFM6

Mor: GKK		Commissioni Obbligazionario Wholesale		RP-MFM6	06 JAN 14 10:29:04	Pag:1
Conto: PROPRIO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		Da 01 DEC 13	a 31 DEC 13	
Data	Provenienza	Simbolo	ID Commissione	Importo	Commissione	Valuta
2/12/2013	PCT	BTI	Clearing Fees	5,78		EUR
2/12/2013	PCT	BTP	Clearing Fees	18,95		EUR
2/12/2013	PCT	OCT	Clearing Fees	6,85		EUR
2/12/2013	PCT	CTZ	Clearing Fees	4,93		EUR
3/12/2013	PCT	BTI	Clearing Fees	12,30		EUR
3/12/2013	PCT	BTP	Clearing Fees	19,22		EUR
3/12/2013	PCT	OCT	Clearing Fees	4,10		EUR
3/12/2013	PCT	CTZ	Clearing Fees	4,91		EUR
4/12/2013	PCT	BTI	Clearing Fees	27,11		EUR
4/12/2013	PCT	BTP	Clearing Fees	608,77		EUR
6/12/2013	PCT	OCT	Clearing Fees	12,33		EUR
15/12/2013	PCT	CTZ	Clearing Fees	162,45		EUR
31/12/2013	MAC	MAC01A	Clearing Fees	678,49		EUR
Tot Conto: PROPRIO				1.391,41		
PROVENIENZA				TOTALI		
PROVENIENZA				TOTALI		
MAC				678,49		
PCT				712,92		
Totale Commissioni:				1.391,41		

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Obbligazionario ed è disponibile il primo giorno del mese successivo a quello di riferimento;
- la colonna "data" indica la data in cui è stata applicata la commissione.

## 2.5.9 RP-MFM8 ICSD - RETAIL COMMISSIONI MENSILI

Il tabulato indica il dettaglio delle commissioni relative alle posizioni del Comparto obbligazionario ICSD maturate nel corso del mese precedente, da liquidarsi il primo giorno lavorativo del mese corrente.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MFM8

4 Mr: XXXX XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX		iCSD - Retail Commissioni Mensili		RP-MFM8	06 JAN 14 10:21:36	Pag:1
Conto: TERZI		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				
		Da 01 DEC 13		a 31 DEC 13		
2/12/2013	MEM	MOT	Clearing Fees	0,40	EUR	
2/12/2013	NET	MOT	Consegna	6,50	EUR	
2/12/2013	NET	TLX	Consegna	5,20	EUR	
2/12/2013	TLX	MOT	Clearing Fees	1,00	EUR	
2/12/2013	TLX	TLX	Clearing Fees	1,80	EUR	
3/12/2013	MEM	MOT	Clearing Fees	1,00	EUR	
3/12/2013	NET	MOT	Consegna	10,40	EUR	
3/12/2013	NET	TLX	Consegna	2,60	EUR	
3/12/2013	TLX	MOT	Clearing Fees	0,20	EUR	
3/12/2013	TLX	TLX	Clearing Fees	1,00	EUR	
4/12/2013	MEM	MOT	Clearing Fees	0,20	EUR	
4/12/2013	NET	MOT	Consegna	6,50	EUR	
30/12/2013	MEM	MOT	Clearing Fees	0,20	EUR	
30/12/2013	TLX	MOT	Clearing Fees	0,80	EUR	
30/12/2013	TLX	TLX	Clearing Fees	0,60	EUR	
31/12/2013	NET	MOT	Consegna	10,40	EUR	
31/12/2013	NET	TLX	Consegna	6,50	EUR	
Tot Conto: TERZI				55,30		
2/12/2013	MEM	MOT	Clearing Fees	3,00	EUR	
2/12/2013	NET	MOT	Consegna	14,30	EUR	
2/12/2013	NET	TLX	Consegna	3,90	EUR	
2/12/2013	TLX	MOT	Clearing Fees	4,60	EUR	
2/12/2013	TLX	TLX	Clearing Fees	0,20	EUR	
3/12/2013	MEM	MOT	Clearing Fees	0,80	EUR	
3/12/2013	NET	MOT	Consegna	16,90	EUR	
3/12/2013	NET	TLX	Consegna	3,90	EUR	
3/12/2013	TLX	MOT	Clearing Fees	2,60	EUR	
18/12/2013	FV	MOT	Consegna	2,60	EUR	
24/12/2013	PZ	MOT	Consegna	3,90	EUR	
30/12/2013	TLX	TLX	Clearing Fees	0,60	EUR	
31/12/2013	NET	MOT	Consegna	20,80	EUR	
31/12/2013	NET	TLX	Consegna	6,50	EUR	
Tot Conto: PROPRIO				84,60		
PROVENIENZA				TOTALI		
PROVENIENZA				TOTALI		
FV				2,60		
MEM				5,60		
NET				114,40		
PZ				3,90		
TLX				13,40		
Totale Commissioni:				139,90		

Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Obbligazionario ICSD ed è disponibile il primo giorno del mese successivo a quello di riferimento;

- la colonna “data” indica la data in cui è stata applicata la commissione.

## 2.5.10 RP-MFM9 ICSD - COMMISSIONI GIORNALIERE

Il tabulato indica il dettaglio delle commissioni giornaliere del Comparto obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MFM9

Mbr: XXXX XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX		iCSD - Commissioni Giornaliere		RP-MFM9	06 JAN 14 10:21:35	Pag: 1
Conto: TERZI		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		Data 31 DEC 13		
20140102ABMMWB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABMO9B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABMSWB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABMVCB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABMZFS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM5QN01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM6XS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNMYS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM19B01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM3YB01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM53B01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNCHS01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNJMS01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
Tot Conto: TERZI				16,90		
1						
Conto: PROPRIO						
20140102ABMJAS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM5FS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM64B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNAIS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNGB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNGGS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNHQS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNHTB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNHZS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNLRB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNL9B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNM4B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNM4S01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNP1S01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNP6B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNQQS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABM7SB01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNEVS01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNE9S01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNF7S01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
20140102ABNI0S01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR	
Tot Conto: PROPRIO				27,30		

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Obbligazionario ICSD ed è disponibile giornalmente;

- la colonna "data" indica la data in cui è stata applicata la commissione.

## 2.6 Sezione VI: Scadenza Opzioni

Questa sezione descrive i tabulati di clearing delle opzioni in scadenza e delle assegnazioni di stock options per eccezione.

### 2.6.1 RP-MX01 OPZIONI IN SCADENZA

Il tabulato mostra per ciascun conto e sottoconto le posizioni contrattuali in opzioni in scadenza, indicando se le stesse sono In-the-Money o Out-of-the-Money, gli eventuali controvalori In-the-Money e le previsioni di esercizio automatico e non automatico. Per le opzioni che prevedono la consegna fisica del sottostante, l'indicazione di esercizio automatico e non automatico ha valore di proposta e come tale potrà essere confermata, non eseguendo alcuna azione, o non confermata, immettendo una diversa istruzione di esercizio, ossia un esercizio per eccezione. Per le opzioni che prevedono la liquidazione per contanti, invece, tale indicazione corrisponderà sempre all'azione che verrà eseguita in quanto per esse l'esercizio per eccezione non è consentito. Per questo motivo le due tipologie di opzioni sono mostrate in due sezioni separate del Report con una diversa descrizione al termine di ciascuna sezione.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MX01

Ader: BAUN BANCA UNO SPA		Opzioni in Scadenza		RP-MX01	15 SEP 16	22:09:43	Pag.	1
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Conto:TERZI		*OMN	Contrattazioni Del: 15 SEP 16					
Esc	Posiz.	Attuale	Pr. Chius.	In/(Out)	Ammontare	Esercizio	Esercizio	Istruz
Serie	Oggi	Corte	Lunghe	Att. Sott.	Of Money	In the Money	Automatico	Non Autom. Di Eserc
3ENI6I12.50	2		12,9200	0,4200				
3UCG6U2.10		10	2,0360	0,0640	640,00		10	
G5W6I11	50		10,9600	( 0,0400)				
G5W6I11.50	50		10,9600	( 0,5400)				
*****								
I CONTRATTI INDICATI NELLA COLONNA "ESERCIZIO AUTOMATICO" SARANNO								
ESERCITATI AUTOMATICAMENTE SALVO DIVERSA ISTRUZIONE.								
*****								
Ader: BAUN BANCA UNO SPA		Opzioni in Scadenza		RP-MX01	15 SEP 16	22:09:43	Pag.	2
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Conto:TERZI		*OMN	Contrattazioni Del: 15 SEP 16					
Esc	Posiz.	Attuale	Pr. Chius.	In/(Out)	Ammontare	Esercizio	Esercizio	Istruz
Serie	Oggi	Corte	Lunghe	Att. Sott.	Of Money	In the Money	Automatico	Non Autom. Di Eserc
4ENI6I12.50	4		12,9200	0,4200				
4UCG6U2.10		10	2,0360	0,0640	640,00		10	
*****								
I CONTRATTI INDICATI NELLA COLONNA "ESERCIZIO AUTOMATICO" SARANNO								
ESERCITATI AUTOMATICAMENTE.								
*****								

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile la mattina della giornata di scadenza prima dell'avvio delle fasi nelle quali è possibile inoltrare le istruzioni di "esercizio per eccezione";
- la colonna "**Pr. Chius. Att. Sott.**" indica il prezzo o il valore dell'attività sottostante utilizzato per determinare se l'opzione è In-the-Money, At-the-Money o Out-of-the-Money;
- la colonna "**In/ (Out)-of-Money**" indica la differenza tra il prezzo o valore dell'attività sottostante e il prezzo di esercizio; se tra parentesi, indica un'opzione Out-of-the-Money. Se il campo è valorizzato con zero l'opzione è considerata At-the-Money; *Euronext Clearing* propone di lasciar scadere tale opzione;
- la colonna "**Ammontare In-the-Money**" indica l'importo in euro determinato moltiplicando il valore della colonna "In /(Out)-of-Money" per il valore del punto indice del contratto d'opzione per il numero di posizioni contrattuali lunghe;
- la colonna "**Esercizio Automatico**" indica le opzioni In-the-Money che *Euronext Clearing* propone di esercitare automaticamente;
- la colonna "**Esercizio Non Automatico**" indica le opzioni At-the-Money o Out-of-the-Money che *Euronext Clearing* propone di lasciare scadere automaticamente.

## 2.6.2 RP-MX04 OPZIONI SU AZIONI ASSEGNATE A SCADENZA

Il tabulato indica le opzioni su azioni assegnate a scadenza.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MX04

Ader: GKK		Opzioni su Azioni Assegnate a Scadenza				RP-MX04	19 JAN 01	8:56:47	Page	1
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
		Scadenza: 19 JAN 01								
	Serie	Conto	Assegnate	Pos. Corte	Controvalore	In/Out of the Money	Ex by Ex			
AUT	JA01	7,20 P	TERZI *OMN	5	7	36.000,00DR	I	*		
BIP	JA01	8,40 P	TERZI *OMN	7	7	58.800,00DR	I			
BIP	JA01	8,60 P	TERZI *OMN	5	5	43.000,00DR	I			
BRM	JA01	1,20 C	TERZI *OMN	2	2	12.000,00DR	I			
BRM	JA01	1,30 C	TERZI *OMN	3	13	19.500,00DR	I			
ENEL	JA01	4 P	TERZI *OMN	9	9	36.000,00DR	I			
ENEL	JA01	4,20 P	TERZI *OMN	6	6	25.200,00DR	I			
ENEL	JA01	4,40 P	TERZI SUB1	50	50	220.000,00DR	I			
F	JA01	26 C	TERZI SUB1	10	10	130.000,00DR	I			
MS	JA01	15,50 P	TERZI SUB1	34	34	527.000,00DR	I			
MS	JA01	17 P	TERZI SUB1	12	12	204.000,00DR	I			
OL	JA01	2,90 C	TERZI SUB1	12	401	174.000,00CR	O	*		
SPG	JA01	2,10 C	TERZI SUB2	10	10	52.500,00DR	I			
SPG	JA01	2,20 C	TERZI SUB2	3	3	16.500,00DR	I			
SPG	JA01	2,50 P	TERZI SUB2	5	5	31.250,00DR	I			
SPI	JA01	18 C	TERZI SUB2	2	2	36.000,00DR	I			
TI	JA01	12 C	TERZI SUB3	26	26	312.000,00DR	I			
TI	JA01	13 C	TERZI SUB3	14	14	182.000,00DR	I			
TI	JA01	13,50 P	TERZI SUB4	8	8	108.000,00DR	I			
TIM	JA01	9 C	TERZI SUB4	1	1	,00DR	A	*		
TIR	JA01	6,40 C	TERZI SUB5	10	10	64.000,00DR	I			
TIR	JA01	6,60 C	TERZI SUB5	20	20	132.000,00DR	I			

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile dopo il termine della fase di assegnazione effettuata da *Euronext Clearing* nella giornata di scadenza;
- la colonna "**Assegnate**", indica il numero di posizioni contrattuali assegnate del totale indicato nella colonna "Pos.Corte"; se il campo non è valorizzato significa che l'opzione non è stata oggetto di assegnazione;
- la colonna "**Pos.Corte**" indica il numero totale di posizioni contrattuali corte per ciascuna Serie di opzioni;
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore di liquidazione delle posizioni contrattuali assegnate;
- la colonna "**In/Out-of-the-Money**" indica, se presente il simbolo "I", che la serie è scaduta In-the-Money; se è presente il simbolo "A", che la Serie è scaduta "At-the-Money". Il simbolo "O" indica che la serie è scaduta Out-of-the-Money;
- nella colonna "**Ex by Ex**", l'asterisco avvisa che l'opzione è stata assegnata o non assegnata a seguito di un "esercizio per eccezione" (ossia esercizio di opzioni Out-of-the-Money o At-the-Money non proposte da *Euronext Clearing* in esercizio automatico o abbandono di opzioni In-the-Money proposte da *Euronext Clearing* in esercizio automatico).

## 2.7 Sezione VII: Liquidazione Sottostanti dei Derivati

Questa sezione descrive i tabulati di clearing delle opzioni esercitate/assegnate o dei futures scaduti, le cui attività sottostanti sono oggetto di regolamento presso il Servizio di liquidazione.

### 2.7.1 RP-MD01 OPZIONI ESERCITATE/ASSEGNATE DA LIQUIDARE

Il tabulato riporta le specie di azioni da "consegnare" e/o "ritirare" in Liquidazione a seguito dell'esercizio/assegnazione di opzioni su singole azioni.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MD01

Mor: GKK		Opzioni Esercitate/assegnate da liquidare		RP-MD01	17 JAN 01	20:44:58	Page 1
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Alla Data Del: 17 JAN 01					
		Da	Da	Data		Già	
Titolo Da Consegnare	Simbolo	Consegnare	Ritirare	Controvalore	Liquid.	Consegnati	
Conto: TERZI							
STIT PAGINE GIALLE	SPG	5.000 A		10.250,00CR	18JAN01	2.500	
STIT PAGINE GIALLE	SPG		7.500 A	15.000,00DR	19JAN01		
STIT PAGINE GIALLE	SPG	2.500 E		5.250,00CR	22JAN01		
Totale Titolo:		7.500	7.500				

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Simbolo**" indica la specie di azione oggetto di "consegna" o "ritiro";
- le colonne "**Da Consegnare**" e "**Da Ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare delle azioni da "consegnare" e da "ritirare"; la lettera "A" indica che le posizioni sono state assegnate, la lettera "E" quelle che sono state esercitate;
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro delle azioni da "consegnare" o "ritirare";
- la colonna "**Già Consegnati**" evidenzia gli eventuali titoli già depositati in garanzia dal Partecipante. L'obbligo di consegna dei titoli nel giorno di liquidazione risulterà pertanto già assolto.

## 2.7.2 RP-MD51 POSIZIONI FUTURES IN CONSEGNA/RITIRO

Il tabulato riporta l'elenco degli strumenti finanziari non derivati da "consegnare" e/o "ritirare" in Liquidazione a fronte delle posizioni Stock *Future* rimaste aperte al termine dell'ultimo giorno di contrattazione.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MD51

Mor: GKK		Posizioni Futures In Consegna/Ritiro		RP-MD51	18 JUL 05	20:50:36	Page 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA							
Alla Data Del: 18 JUL 05							
Titolo Da Consegnare	Simbolo	Da Consegnare	Da Ritirare	Controvalore	Data Liquid.	Gia Consegnati	
Conto: TERZI							
AAAA ORDINARIE	ENEL	1.900.000 C		13.281.000,00	20JUL05		
Totale Titolo: IT0003128367		1.900.000 Consegna	Controvalore:	13.281.000,00			
BBB ORDINARIE	ENI	5.300.000 C		121.635.000,00	20JUL05		
Totale Titolo: IT0003132476		5.300.000 Consegna	Controvalore:	121.635.000,00			
Totale Controvalore del 20 JUL 05 :				134.916.000,00			

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile la mattina successiva al giorno di scadenza, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Simbolo**" indica la specie titolo e il suo codice ISIN;
- le colonne "**Da Consegnare**" e "**Da Ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare delle azioni da "consegnare" e da "ritirare"; la lettera "A" indica che le posizioni sono state assegnate, la lettera "E" quelle che sono state esercitate;
- la colonna "**Controvalore**" evidenzia l'importo in euro da regolare in liquidazione;
- la colonna "**Data di liquidazione**" indica la data di liquidazione del contratto;
- la colonna "**Già Consegnati**" evidenzia gli eventuali titoli già depositati in garanzia dal Partecipante. L'obbligo di consegna dei titoli nel giorno di liquidazione risulterà pertanto già assolto.

## 2.7.3 RP-MD55 TITOLI E CONTROVALORI IN LIQUIDAZIONE SOTTOSTANTI DEI DERIVATI AZIONARI

Il tabulato viene prodotto per gli Agenti di Regolamento della liquidazione e riporta, per ciascun partecipante Diretto al comparto Derivati Azionari per il quale l'Agente di Regolamento effettua il servizio, l'elenco degli strumenti finanziari da "consegnare" e/o "ritirare" in Liquidazione a fronte delle posizioni contrattuali in stock options esercitate/assegnate e/o in stock *Future* rimaste aperte al termine dell'ultimo giorno di contrattazione.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MD55

Ader: SSS		Titoli e controvalori in liquidazione			RP-MD55	15 JUL 05	21:04:48	Pag. 1
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Esercizi/Assegnazioni del:		15 JUL 05	Liquidazione del:		20 JUL 05			
Conto:	Terzi		Ritiro	Consegna	Consegnati	Saldo	C/R	Controvalore
GKK		60444						
IT0001254884	BANCA NAZIONALE DEL LAVORO		2.860.000			2.860.000	R	7.722.000,00 DR
IT0003132476	ENI		25.000			25.000	R	500.000,00 DR
IT0001976403	FIAT		395.000	183.000		212.000	R	1.173.900,00 DR
IT0003039010	RCS MEDIAGROUP		120.000			120.000	R	696.000,00 DR
IT0001269361	SAN PAOLO IMI		250.000			250.000	R	2.875.000,00 DR
IT0003497168	TELECOM ITALIA			100.000		100.000	C	260.000,00 CR
						Totale		12.706.900,00 DR
ACX		60555						
IT0003121495	CAPITALIA		710.000			710.000	R	3.124.000,00 DR
IT0003128367	ENEL ORDINARIE		900.000			10.900.000	R	76.191.000,00 DR
IT0003132476	ENI ORDINARIE		7.180.000			7.180.000	R	164.781.000,00 DR
						Totale		244.096.000,00 DR

- **Ader:** individua l'Agente di Regolamento al quale il report è destinato;
- **Esercizi/Assegnazioni:** indica il giorno di esercizio /assegnazione delle stock options e/o il giorno di scadenza degli stock futures;
- GKK è il nome del Partecipante Diretto per il quale l'Agente di Regolamento è chiamato a regolare gli strumenti finanziari in Liquidazione. A destra, sulla stessa riga, è indicato il conto di liquidazione che l'agente di regolamento utilizza per regolare gli strumenti finanziari del Partecipante Diretto GKK;
- la colonna "Ritiro" ("Cons.") indica la quantità di strumenti finanziari da ritirare (consegnare);
- la colonna "**Consegnati**" evidenzia gli eventuali titoli già depositati in garanzia dal Partecipante. L'obbligo di consegna dei titoli nel giorno di liquidazione risulterà pertanto già assolto;
- la colonna "**Controvalore**" evidenzia l'importo in euro da regolare il giorno di Liquidazione.

## 2.8 Sezione VIII: Fail, Buy-In e Sell-Out

Questa sezione descrive i tabulati di clearing relativi alle posizioni in fail ed alle procedure di Buy-in e Sell-out.

### 2.8.1 RP-ME30 POSIZIONI IN FAIL MARGINABILI - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME30

Ader: GKK		Posizioni in fail marginabil RP-ME30		17 FEB 04	21:04:46	Pag. 1				
		(Comparto Azionario e Derivati Azionari)		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
				Posizioni Iniziali al: 18 FEB 04						
Conto: TERZI										
ID	ID	Data	Scadenza	Titoli da	Titoli da					
Netta	DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	ricevere	Controvalore	
5AU763	1KH6TR	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000		8.400,00 CR	
7AD93J	1KH9VF	ENI	ENI	IT0003132476	16 FEB 04	25 FEB 04		50	700,00 DR	
Conto: PROPRIO										
ID	ID	Data	Scadenza	Titoli da	Titoli da					
Netta	DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	ricevere	Controvalore	
8UH3W	1KH7YG	Fiat	F	IT0003132476	17 FEB 04	26 FEB 04	100		700,00 DR	

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti e per tutti gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail. Se il campo non è valorizzato, la posizione in fail è relativa ad un saldo contanti;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing del titolo oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, Euronext Clearing esegue il Buy-In/Sell-Out. Se il fail è generato dal partecipante per mancanza di contante o in caso di attivazione di Buy-In anticipato, Euronext Clearing modifica nei giorni successivi, con apposita comunicazione inoltrata al partecipante (cfr. reports RP-ME01, e RP-ME03), la data di scadenza del fail. La nuova data viene riportata nel report in distribuzione il giorno in cui sono distribuiti i report RP-ME01 e RP-ME03;
- le colonne "**titoli da consegnare**" e "**titoli da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail deve "consegnare" o "ritirare";

- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

## 2.8.2 RP-ME31 POSIZIONI IN FAIL MARGINABILI - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail relativo al Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME31

Ader: GKK		Posizioni in fail marginabili			RP-ME31	17 FEB 04	21:04:46	Pag. 1
		(Comparto Obbligazionario)						
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
		Posizioni Iniziali al: 18 FEB 04						
Valuta : EURO								
Settlement System: ECLR/CEDE								
Conto: PROPRIO								
ID			Data	Scadenza	Titoli da	Titoli da		
CCG	Titolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	ricevere	Controvalore	
20130606ABCD1S01	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	16 FEB 04	23 FEB 04	50.000		686.450,00	CR
Valuta : EURO								
Settlement System: MOTT								
Conto: PROPRIO								
ID CCG	ID CCG		Data	Scadenza	Titoli da	Titoli da		
Netta	DVP	Titolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	ricevere	Controvalore
6BG7HJ	1KH96Z	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	16 FEB 04	23 FEB 04	50.000		686.450,00

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti e per tutti gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti al Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni.
- Il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra.
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE).
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN del titolo oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, Euronext Clearing esegue il Buy-In/Sell-Out. Se il fail è generato dal partecipante per mancanza di contante o in caso di attivazione di Buy-In anticipato, Euronext Clearing modifica nei giorni successivi, con apposita comunicazione inoltrata al partecipante (cfr. reports RP-ME02, e RP-ME04), la data di scadenza del fail. La nuova data viene riportata nel report in distribuzione il giorno in cui sono distribuiti i report RP-ME02 e RP-ME04;
- le colonne "**titoli da consegnare**" e "**titoli da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail deve "consegnare" o "ritirare";

- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

### 2.8.3 RP-MP10 POSIZIONI FAIL - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail, del giorno e dei giorni precedenti, relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP10

Ader: GKK		Posizioni fail MTA-DER		RP-MP10		15 JAN 04 23:08:20 Pag. 1				
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA										
Posizioni in Fail al: 15 JAN 04										
Simbolo	Data Liquid.	Data Scad.Fail	Cto	Posizioni L/C	Quantità	Prezzo Riferimento	Controvalore Corrente	Credito/Debito Teorico	MKT	
TIM	13 JAN 04	22 JAN 04	T	C	9	4,65300000	39,60CR	41,87	2,27	MTA
TIT	13 JAN 04	22 JAN 04	T	C	5	2,61800000	10,00CR	13,09	3,09	MTA
Saldo liquidazione del: 13 JAN 04				Conto TERZI	49,60CR	Conto Liquidazione	76666			
BFI	15 JAN 04	26 JAN 04	T	C	7	5,13400000	35,42CR	35,93	,51	MTA
EDN	15 JAN 04	26 JAN 04	T	C	13	1,53900000	19,89CR	20,00	,11	MTA
F	15 JAN 04	26 JAN 04	T	C	11	6,23600000	62,15CR	68,59	6,44	MTA
G	15 JAN 04	26 JAN 04	T	C	11	21,60000000	234,90CR	237,60	2,70	MTA
LUX	15 JAN 04	26 JAN 04	T	C	22	13,19000000	304,92CR	290,18	14,74CR	MTA
NTV	15 JAN 04	26 JAN 04	T	C	19	14,80300000	258,97CR	281,25	22,28	MTA
TIT	15 JAN 04	26 JAN 04	T	L	20	2,61800000	50,80	52,36	1,56CR	MTA
Saldo liquidazione del: 15 JAN 04				Conto TERZI	865,45CR	Conto Liquidazione	76666			

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari con posizioni in fail ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing del titolo sottostante la posizione in fail;
- la colonna "**Data Liquid.**" indica la data di liquidazione entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**Data scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata;
- la colonna "**Cto**" indica il conto Proprio (P) o Terzi (T) a cui il fail si riferisce;
- la colonna "**(Posizioni) L/C**" indica se la posizione in fail è relativa ad un acquisto (L) o ad una vendita (C);
- la colonna "**(Posizioni) Quantità**" indica il numero di posizioni in fail;
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in Euro degli strumenti finanziari da "consegnare" "ritirare";
- la colonna "**Prezzo di Riferimento**" indica il Prezzo di Riferimento del titolo relativo alla giornata di negoziazione a cui si riferisce il report;
- la colonna "**Controvalore corrente**" indica il controvalore in Euro del titolo da "consegnare" o "ritirare", ricalcolato al prezzo di Riferimento;
- la colonna "**Credito/Debito teorico**" indica la differenza tra il "Controvalore" e il "Controvalore corrente";
- la colonna "**MKT**" indica il mercato di provenienza del fail.

## 2.8.4 RP-MP13 POSIZIONI FAIL - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail, del giorno e dei giorni precedenti, relative al Comparto Obbligazionario e al comparto Obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP13

Ader: GKK		Posizioni Fail Comparto Obbligazionario		RP-MP13	15 JAN 04	21:50:57	Pag. 1	
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		Posizioni in Fail al: 15 JAN 04				
Curr: EUR								
Settlement System: ECLR/CEDE								
Titolo	Codice	Data	Data	Ty	Ac	L/C	Quantità	Controvalore
	Isin	Liquid	Scad.Fail	pe	ct	C		Controvalore
								Rateo
BTP 15/03/04 4,50%	IT0003101992	15 JAN 04	15 JAN 04	T	C		6.686.000	6.903.845,93CR
BTP 15/07/05 4,00%	IT0003231146	15 JAN 04	15 JAN 04	T	C		1.642.000	1.684.360,78CR
Saldo del: 15 JAN 04 Conto		TERZI	8.588.206,71CR					

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD con posizioni in fail ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- la colonna "**Codice ISIN**" indica l'ISIN del titolo oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di Liquidazione**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**Data scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata;
- la colonna "**Type**", nei contratti "pronti contro termine", è valorizzata con "P", per indicare la gamba a pronti, o "T", per indicare la gamba a termine;
- la colonna "**Acct**" indica il conto Proprio (P) o Terzi (T) a cui il fail si riferisce;
- la colonna "**L/C**" indica se la posizione in fail è relativa ad un acquisto (L) o ad una vendita (C);
- la colonna "**Quantità**" indica la quantità degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in Euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare" ed è comprensivo del "**Controvalore Rateo**" di cui alla colonna successiva.

## 2.8.5 RP-MP14 POSIZIONI IN FAIL - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail, del giorno e dei giorni precedenti, relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP14

Ader: GKK										
Posizioni fail (Azionario & Derivati)										
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA										
Posizioni in Fail al:' 3 MAY 12										
Simbolo	Data Liquid.	Data Scad.Fail	Cto L/C	Posizioni Quantità	Controvalore	Prezzo Riferimento	Controvalore Corrente	Credito/Debito Teorico	MKT	
Gcm : 00999 PHHHH										
CVAL	02 MAY 12	11 MAY 12	T L	150.000	169.394,59	1,08100000	162.150,00	7.244,59	MTA	
PIA	02 MAY 12	11 MAY 12	T L	150.000	313.982,75	2,27200000	340.800,00	26.817,25CR	MTA	
Saldo liquid.: 02 MAY 12 Conto: TERZI					483.377,34	Conto Liquidazione: 70631				
MOL	03 MAY 12	14 MAY 12	T L	1.329	4.452,15	3,43000000	4.558,47	106,32CR	MTA	
SEML	03 MAY 12	14 MAY 12	T L	650	47.125,00	73,20000000	47.580,00	455,00CR	MTA	
Saldo liquid.: 03 MAY 12 Conto: TERZI					51.577,15	Conto Liquidazione: 70631				

- il tabulato viene prodotto per tutti gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari con posizioni in fail ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- "**Ader**" indica l'Agente di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari con posizioni in fail;
- la colonna "**Simbolo**" indica l'acronimo di clearing del titolo sottostante la posizione in fail;
- la colonna "**Data Liquid.**" indica la data di liquidazione entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**Data scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata;
- la colonna "**Cto**" indica il conto Proprio (P) o Terzi (T) a cui il fail si riferisce;
- la colonna "**(Posizioni) L/C**" indica se la posizione in fail è relativa ad un acquisto (L) o ad una vendita (C);
- la colonna "**(Posizioni) Quantità**" indica il numero di posizioni in fail;
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in Euro degli strumenti finanziari da "consegnare" "ritirare";
- la colonna "**Prezzo di Riferimento**" indica il Prezzo di Riferimento del titolo relativo alla giornata di negoziazione a cui si riferisce il report;
- la colonna "**Controvalore corrente**" indica il controvalore in Euro del titolo da "consegnare" o "ritirare", ricalcolato al prezzo di Riferimento;
- la colonna "**Credito/Debito teorico**" indica la differenza tra il "Controvalore" e il "Controvalore corrente";
- la colonna "**MKT**" indica il mercato di provenienza del fail.

## 2.8.6 RP-MP15 POSIZIONI FAIL - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail, del giorno e dei giorni precedenti, relative ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MP15

Ader: GKK		Posizioni Fail Comparto Obbligazionario		RP-MP15	07 MAY 12	21:50:57	Pag. 1
EUR		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Posizioni in Fail al: 7 MAY 12					
Cur: EUR							
Settlement System: ECLR/CEDE							
Titolo	Codice	Data	Data	Ty Ac L/C	Quantità	Controvalore	Controvalore
	Isin	Liquid	Scad.Fail pe ct C				Rateo
Gcm: RXXXXX							
BTP 15/03/04	4,50%	IT0003101992	07 MAY 12	21 MAY 12	T C	6.686.000	6.903.845,93CR
BTP 15/07/05	4,00%	IT0003231146	07 MAY 12	21 MAY 12	T C	1.642.000	1.684.360,78CR
Saldo del: 07 MAY 12 Conto: TERZI		8.588.206,71CR					

- il tabulato viene prodotto per tutti gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD con posizioni in fail ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- **"Ader"** indica l'Agente di Regolamento dei Partecipanti al Comparto Obbligazionario con posizioni in fail;
- la colonna **"Titolo"** indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- la colonna **"Codice ISIN"** indica l'ISIN del titolo oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna **"Data di Liquidazione"** indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna **"Data scadenza fail"** indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata;
- la colonna **"Type"**, nei contratti "pronti contro termine", è valorizzata con "P", per indicare la gamba a pronti, o "T", per indicare la gamba a termine;
- la colonna **"Acct"** indica il conto Proprio (P) o Terzi (T) a cui il fail si riferisce;
- la colonna **"L/C"** indica se la posizione in fail è relativa ad un acquisto (L) o ad una vendita (C);
- la colonna **"Quantità"** indica la quantità degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare";
- la colonna **"Controvalore"** indica il controvalore in Euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare" ed è comprensivo del **"Controvalore Rateo"** di cui alla colonna successiva.

## 2.8.7 RP-MS97 MARGINI POSIZIONI FAIL - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta i margini applicati sulle posizioni in fail relative ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS97

Margini Posizioni Fail Comparto Obbligazionario AL 10 SEP 08 MS97 10 SEP 08 21:08:15 Page 1									
GCM : GKK									
Aderente: GKK									
Conto: C Sottoconto:									
Cur: EUR									
Parametro di maggioraz 10%									
ID	Num.	Classe	Posizione	Posizione	Interv.	Margine non	%	Margine	Margine
RRG-REL	gg/fail		Lunga	Corta	Margine	rettificato	Modul	Ordinario	Mark-to-Market
02L3BA	2	02	0	3.968.520	0,35	16.668			1.525,17-
OLIAWX	1	02	0	496.065	0,35	1.910			75,27-
TOTALE						18.578	0,000	18.578	1.600-
						Margini iniziali		20.178	

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD con posizioni in fail ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- la colonna "**Num. gg/fail**" indica da quanti giorni la posizione è in fail;
- la colonna "**Classe**" indica la classe di appartenenza dello strumento finanziario;
- per ulteriori dettagli sulle modalità di determinazione dei Margini iniziali per il Comparto Obbligazionario si rimanda al Manuale MVP disponibile sul sito web di Euronext Clearing ([www.euronext.com](http://www.euronext.com)) alla sezione [Risk Management>Metodologie](#).

## 2.8.8 RP-MF13 MAPPATURA MARGINI INIZIALI POSIZIONI FAIL PAESI SOVRANI

Il tabulato riporta i flussi di pagamento al valore di mercato mappati sulle relative scadenze della curva sovrana per ogni sotto-portafoglio in fail ad una determinata data.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MF13

Sub-Portfolio	Sovereign	Tenor (Y)	Net cash floo (Mkt)
B	ES	,25	58,26
B	ES	,50	13,20
B	ES	1,00	59,25
B	ES	2,00	60,83
B	ES	3,00	1101,92
B	ES	4,00	3647,42
B	ES	5,00	743,80
B	IE	,50	95,44
B	IE	1,00	54,10
B	IE	2,00	114,22
B	IE	3,00	111,94
B	IE	4,00	107,48
B	IE	5,00	104,32
B	IE	6,00	100,42
B	IE	7,00	97,25
B	IE	8,00	94,10
B	IE	9,00	93,67
B	IE	10,00	232,39
B	IE	15,00	549,33
B	IE	20,00	2298,21
M_IT0004848476_01	IT	3,00	2789,60
M_IT0004848476_01	IT	4,00	7001,50
M_IT0004848492_01	IT	7,00	6172,56
M_IT0004848492_01	IT	8,00	1621,44
M_IT0005445306_02	IT	,25	393,65

## 2.8.9 RP-MF14 MARGINI INIZIALI POSIZIONI FAIL PAESI SOVRANI – EXP. SHORT.

Il tabulato contiene l'ES della variazione del valore del portafoglio per Paese sovrano per ogni sotto-portafoglio in fail ad una determinata data.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MF14

Sub-Portafolio		Sovereign	Unscaled ES	Scaled ES	ES
B	ES		253,00	211,00	253,00
B	IE		699,00	659,00	699,00
B	PT		160,00	123,00	160,00
M_IT0004848476_01	IT		551,00	549,00	551,00
M_IT0004848492_01	IT		758,00	803,00	803,00
M_IT0004848492_01	IT		38.026,00	38.037,00	38.037,00
M_IT0005445306_02	IT		5.695,00	5.737,00	5.737,00

## 2.8.10 RP-MF15 TOTALE MARGINI FAIL

Il tabulato contiene il totale dei margini in fail per ogni sotto-portafoglio ad una determinata data.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MF15

Ader:CCG		Fail Total Margins				AL 14 FEB 24	MF15	14 FEB 24	20:51:02	Page 1
GCM	: XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX								
Aderente:	XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX								
Conto:	C									
Sub-Portfolio	Sove	MtM Margin	Corp. Add. Marg.	Price ES	Decorrelation	Idiosyn.	Margin	Liquidity	Margins	
Code	Corp	EUR	EUR		Add-On	Add-On	Floor	Add-On		
B	CORP	4.386-	96.706	0	0	0		0	101.092	
B	IT	592	0	13.256	116	0		79	12.859	
								Floored		
								Total	113.951	
Ader:CCG		Fail Total Margins				AL 14 FEB 24	MF15	14 FEB 24	20:51:02	Page 1
GCM	: XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX								
Aderente:	XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX								
Conto:	C									
Sub-Portfolio	Sove	MtM Margin	Corp. Add. Marg.	Price ES	Decorrelation	Idiosyn.	Margin	Liquidity	Margins	
Code	Corp	EUR	EUR		Add-On	Add-On	Floor	Add-On		
B	CORP	468-	10.578	0	0	0		0	11.046	
M_XS2027957815_01	CORP	688	11.637	0	0	0		0	10.949	
B	IT	944	0	7,417	35	0		686	7.194	
								Floored		
								Total	29.189	

### 2.8.11 RP-MS90 MARGINI INIZIALI FAIL COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il presente tabulato illustra le diverse componenti dei margini iniziali calcolati per i fail del Comparto Obbligazionario e per il Comparto Obbligazionario ICSD e suddivisi per valuta.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS90

Calcolo Margini Iniziali Fail Comparto Obbligazionario - AL 10 DEC 12 MS90 10 DEC 12 10:41:05 Page 1						
GCM : GKK						
Aderente: GKK						
Conto : F      Sottoconto:						
MARGINI INIZIALI						
CUR	Margini Ordinari	Margini di Mark to Market	Margini Iniziali	Cambio	Haircut	Margine Iniziali
EUR	5.000	1.500	6.500	1,0000	,00	6.500,00
USD	2.000	130	2.130	0,7696	1,06	1.737,60
<b>TOTALE</b>	<b>EURO</b>					<b>8.327,60</b>

- Il report riporta una tabella in cui, per ogni valuta, è indicato l'importo dei margini calcolati in valuta, l'importo in Euro calcolato tramite tasso di cambio e l'haircut applicato.
- La tabella indica inoltre il totale dei margini in euro.

## 2.8.12 RP-MS91 CONTRATTI SELEZIONATI

Il presente tabulato illustra il dettaglio dei contratti in fail selezionati per GCM, Aderente, Conto e per valuta.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS91

Ader: CCG		Calcolo dei Margini Fail		AL	4 FEB 14	MS91	4 FEB 14	21:46:19	Page	1	
CONTRATTI SELEZIONATI											
GCM	:	XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX								
Aderente:	:	XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX								
Conto	:	F	Sottoconto:								
Valuta	:	EUR	EUR								
ISIN	Tipo	L/S	Identif.Op	Data	Data	Data	Fine	Quantità	Controvalore	Group	Gro
			RRG-REL	RRG-REL	regolam.	validità					coll
IT0004890882	BTI	S	R320PB	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A	
IT0004890882	BTI	S	R320P9	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A	
IT0004890882	BTI	S	R320PD	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A	
IT0004890882	BTI	S	R320PF	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A	
IT0004890882	BTI	S	R320PJ	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,76	BOND	A	
IT0004890882	BTI	S	R320PH	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A	
XS0953215349	MOT	S	ACPR5S	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	100.000,000	111.089,73	BOND	A	

- Il report riporta una tabella in cui, per ogni valuta, è indicato l'elenco di contratti selezionati.

### 2.8.13 RP-MS92 CALCULATION OF INITIAL MARGINS

Il presente tabulato illustra il dettaglio del calcolo dei margini iniziali fail per GCM, Aderente, Conto e per valuta.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS92

Member : CCG Calculation of Initial Margins AT 4 FEB 14 MS92 4 FEB 14 21:46:21 Page 1							
GCM : XXXX XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX							
Member : XXXX XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX							
Account : C Subaccount:							
Currency: EUR EUR							
Margine Mark-to-Market							
ISIN	L/S	Identif.Op	Traded	MTM	Quantity	Revalued	Mark-to-Mark
		RRG-REL	Countervalue	Price	Traded	Countervalue	Marg
IT0004890882	S	R320PB	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320P9	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PD	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PF	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PJ	5.132.297,76	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PH	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
XS0953215349	S	ACPR5S	111.089,73	109,300000	100000,000	109.300,00	789,7

- Il report riporta una tabella in cui, per ogni valuta, è indicato l'elenco del calcolo dei margini iniziali.

## 2.8.14 RP-MS93 CALCOLO DEI MARGINI FAIL

Il presente tabulato illustra il dettaglio del calcolo dei margini fail per GCM, Aderente, Conto e per valuta.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS93

Ader	: CCG	Calcolo dei Margini Fail	AL	4 FEB 14	MS93	4 FEB 14	21:46:25	
Page								
GCM	: XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX						
Aderente:	XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX						
Conto	: F	Sottoconto:						
Valuta	: EUR	EUR						
			Attribuzione delle Classi					
ISIN		Posizione	Posizione		Rendimento		Duration	
Classe								
		Lunga	Corta		Effettivo			
	IT0004890882	0,00	30.687.552,00		0,000000		0,0000	
01								
	XS0953215349	0,00	109.300,00		0,000000		5,6932	
33								

- Il report riporta una tabella in cui, per ogni valuta, è indicato l'elenco del calcolo dei margini fail.

## 2.8.15 RP-ME01 BUY-IN NOTICE - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail per le quali è stato attivato il Buy-In relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME01

Ader: GKK		Buy-in Notice			RP-ME01	20 FEB 04	21:04:46	Pag. 1
(Comparti Azionario e Derivati Azionari)								
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
Attivazione buy-in dal 21 FEB 04								
Si informa che la CC&G ha attivato la procedura di Buy-in per le sotto indicate posizioni in fail. Qualora tali posizioni non venissero regolate entro il: 25 Febbraio 04, la CC&G provvederà alla chiusura forzata delle stesse mediante esecuzione del Buy-In secondo quanto previsto dalle Istruzioni.								
Conto: TERZI								
ID	ID				Data	Scadenza	Titoli da	
Netta	DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	Controvalore
5AU763	1KH6TR	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FB 04	1.000	8.400,00 CR

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari in caso di attivazione del Buy-in, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Buy-in;
- la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, Euronext Clearing esegue il Buy-In;
- le colonne "**titoli da consegnare**" e "**titoli da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail deve "consegnare" o "ritirare";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

## 2.8.16 RP-ME02 BUY-IN NOTICE - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail per le quali è stato attivato il Buy-in relative al Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME02

Ader: GKK		Buy-in Notice		RP-ME02 18 FEB 13 21:04:46 Pag. 1			
		(Comparto Obbligazionario)					
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Attivazione buy-in dal 18 FEB 04					
Curr: EURO							
Settlement System : 51 ECLR/CEDE							
Si informa che CC&G ha attivato la procedura di Buy-in per le sotto indicate posizioni in fail. Qualora tali posizioni non venissero regolate entro il: 22 Febbraio 13, CC&G provvederà alla chiusura forzata delle stesse mediante l'esecuzione del Buy-In secondo quanto previsto dalle Istruzioni.							
Conto: PROPRIO							
ID	ID			Data	Scadenza	Titoli da	
Netta	DVP	Titolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	Controvalore
E36PUN	1KH064	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	13 FEB 13	22 FB 13	50.000	686.450,00 CR

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti al Comparto Obbligazionario e al Comparto obbligazionario ICSD in caso di attivazione del Buy-in, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Buy-in;
- Il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities;
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE);
- la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN del titolo oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, Euronext Clearing esegue il Buy-In;
- le colonne "**titoli da consegnare**" e "**titoli da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail deve "consegnare" o "ritirare";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

## 2.8.17 RP-ME03 SELL-OUT NOTICE - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail per le quali è stato attivato il Sell-Out relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME03

Ader: GKK		Sell-out Notice (Comparti Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Attivazione sell-Out dal 17 FEB 04				RP-ME03 16 FEB 04 21:04:46 Pag.			
Si informa che la CC&G ha attivato la procedura di Sell-Out per le sotto indicate posizioni in fail. Qualora tali posizioni non venissero regolate entro le: ore 10.00 odierne, la CC&G provvederà alla chiusura forzosa delle stesse mediante l'esecuzione del Sell-Out secondo quanto previsto dalle Istruzioni.									
Conto: TERZI									
ID	ID				Data	Scadenza	Titoli da		
Netta	DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	regolamento	fail	ritirare	Controvalore	
I114EW	9HLTL9	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000	8.400,00 DR	

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari in caso di attivazione del Sell-Out, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Sell-Out;
- la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, Euronext Clearing esegue il Sell-Out;
- le colonne "**titoli da consegnare**" e "**titoli da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail deve "consegnare" o "ritirare";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

## 2.8.18 RP-ME04 SELL-OUT NOTICE - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail per le quali è stato attivato il Sell-Out relativo al Comparto Obbligazionario.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME04

Ader: GFK		Sell-out Notice		RP-ME04	16 FEB 04	21:04:46	Pag. 1
		Comparto Obbligazionario					
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Attivazione sell-out dal 17 FEB 04					
Curr: EURO							
Settlement System : 51 ECLR/CEDE							
Si informa che la CC&G ha attivato la procedura di Sell-Out per le sotto indicate posizioni in fail. Qualora tali posizioni non venissero regolate entro le: ore 10.00 odierne, CC&G provvederà alla chiusura forzata delle stesse mediante l'esecuzione del Sell-Out secondo quanto previsto dalle Istruzioni							
Conto: PROPRIO							
ID	ID			Data	Scadenza	Titoli da	
Netta	DVP	Titolo	ISIN	regolamento	fail	ritirare	Controvalore
D4R03P	1KFNEF	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	16 FEB 04	23 FB 04	50.000	686.450,00 DR

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti al Comparto Obbligazionario e al Comparto Obbligazionario ICSD in caso di attivazione del Sell-Out, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Sell-Out;
- Il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra.
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail. Se il campo non è valorizzato, la posizione in fail è relativa ad un saldo contanti;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, Euronext Clearing esegue il Sell-Out;
- le colonne "**titoli da consegnare**" e "**titoli da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail deve "consegnare" o "ritirare";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

## 2.8.19 RP-ME05 NOTIFICA DI ESECUZIONE DI BUY-IN - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari, per le quali è stato eseguito il Buy-In.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME05

Ader: GKK		Esecuzione Buy-in		RP-ME05 25 FEB 04 21:04:46		Pag. 1		
(Comparti Azionario e Derivati Azionari)								
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA								
Esecuzione buy-in del 26 FEB 04								
Si informa che, ai sensi delle Istruzioni, a partire dalla data odierna è stata attivata l'esecuzione del Buy-In per le sotto indicate posizioni in fail:								
Conto: TERZI								
ID CCG	ID CCG			Data	Scadenza	Titoli da		
Netta	DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	Controvalore
5AU763	1KH6TR	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000	8.400,00 CR

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari in caso di esecuzione del Buy-In, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Buy-In;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- la colonna "**Titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- la colonna "**Simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- la colonna "**Scadenza fail**" (data di fine validità) indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail poteva essere regolata;
- la colonna "**Titoli da consegnare**" indica l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail doveva "consegnare";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" . "CR" indica che il Partecipante è a credito;

Nel caso in cui il Partecipante effettui una consegna parziale a Euronext Clearing, il tabulato riporterà due parti aggiuntive:

Ader: GKK		Esecuzione Buy-in		RP-ME05 23 NOV 09 21:04:46		Pag. 1		
(Comparti Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Esecuzione buy-in del 24 Nov 2009								
Si informa che, ai sensi delle Istruzioni, a partire dalla data odierna è stata attivata l'esecuzione del Buy-In per le sotto indicate posizioni in fail:								
Conto: TERZI								
ID Netta CCG	ID DVP CCG	Titolo	Simbolo	ISIN	Data di Regolamento	Data fine validità	Titoli da consegnare	Controvalore
4T5S3G	ELNGAW	ETF FTSE E	IUSP	IE00B1FZSF77	13 NOV 09	23 NOV 09	23.534,00	220.288,09 CR
"PER LA POSIZIONE IN FAIL DI CUI SOPRA CC&G HA AUTORIZZATO LA CONSEGNA PARZIALE DELLA SEGUENTE QUANTITA' TITOLI"								
Titolo	Simbolo	ISIN	Titoli consegnati	Controvalore				
ETF FTSE E	IUSP	IE00B1FZSF77	20.000,00	187.208,38	CR			
QUANTITA' TITOLI PER ESECUZIONE BUY-IN:								
Titolo	Simbolo	ISIN	Titoli da consegnare	Controvalore				
ETF FTSE E	IUSP	IE00B1FZSF77	3.534,00	33.079,71	DR			
Il controvalore sarà riconosciuto da CC&G nell'ambito del ciclo netto notturno del 26 NOV 09								
ISIN	Data eseguito	Data regolamento	Data fine validità	Titoli da consegnare	Controvalore			
IT0000010014	23 NOV 09	26 NOV 06	26 NOV 06	0,00	187.208,38	CR		
Se nel ciclo lordo di liquidazione è presente un'istruzione in "bonis" con data di fine validità successiva a quella dell'istruzione in fail di cui sopra, nel presente report viene visualizzata la seguente voce: "il controvalore sarà riconosciuto da CC&G durante un prossimo ciclo netto notturno".								

### Seconda parte - Consegna parziale:

- la colonna "**Titolo**" indica lo strumento finanziario oggetto di "consegna parziale";
- la colonna "**Simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna parziale";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna parziale";
- la colonna "**Titoli consegnati**" indica l'ammontare degli strumenti finanziari relativi alla "consegna parziale";
- la colonna "**Controvalore**" indica la quota parte del controvalore originario in euro degli strumenti finanziari della "consegna parziale". "CR" indica che il Partecipante è a credito.

### Seconda parte - Quantità titoli per esecuzione Buy-In:

- la colonna "**Titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in esecuzione di Buy-In;

- la colonna "**Simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario in esecuzione di Buy-In;
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario in esecuzione di Buy-In;
- la colonna "**Titoli da consegnare**", trattandosi di un compenso di solo contante, presenta un campo valorizzato a "0";
- la colonna "**Controvalore**" indica la quota parte del controvalore originario in euro degli strumenti finanziari in esecuzione di Buy-In. "CR" indica che il Partecipante è a credito.

*Terza parte - Compensi inseriti nel ciclo netto notturno:*

- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN del compenso di solo contante;
- la colonna "**Data eseguito**" indica la data di inserimento del compenso di contante da parte di Euronext Clearing;
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione verrà liquidata;
- la colonna "**Data fine validità**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail deve essere liquidata;
- le colonne "**Titoli da consegnare**" indicano l'ammontare degli strumenti finanziari che il partecipante in fail deve "consegnare";
- la colonna "**Controvalore**" indica la quota parte del controvalore originario in euro degli strumenti finanziari della "consegna parziale". "CR" indica che il Partecipante è a credito.

## 2.8.20 RP-ME06 NOTIFICA DI ESECUZIONE DI BUY-IN - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo al report RP-ME05. In aggiunta a tale report:

- il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne ID Netta e ID DVP indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna ID CCG indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- Qualora la valuta di regolamento dell'istruzione sia diversa dall'Euro, in caso di consegna parziale il report informerà circa le modalità di regolamento dell'istruzione parzializzata.

## 2.8.21 RP-ME07 NOTIFICA DI ESECUZIONE DI SELL-OUT - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari, per le quali verrà eseguito il *Sell-Out*.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME07

Ader: GKK		Esecuzione Sell-Out (Comparti Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Esecuzione Sell-Out del 17 FEB 04			RP-ME07 17 FEB 04 10:04:46	Pag. 1		
Si informa, ai sensi delle Istruzioni, a partire dalle ore 10.00 di oggi è in corso l'esecuzione delle sotto indicate posizioni in fail.								
Conto: TERZI								
ID	ID	Titolo	Simbolo	ISIN	Data regolamento	Scadenza fail	Titoli da ritirare	Controvalore
Netta	DVP	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000	8.400,00 DR

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari in caso di esecuzione del Sell-Out, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Sell-Out;
- la colonna "titolo" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail. I fail potrebbe essersi generato da posizioni relative sia al Comparto Azionario sia al Comparto Derivati Azionari;
- la colonna "simbolo" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "ISIN" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "Data di regolamento" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "scadenza fail" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail doveva essere regolata;
- le colonne "titoli da consegnare" e "titoli da ritirare" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari da "consegnare" e da "ritirare";
- la colonna "Controvalore" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

## 2.8.22 RP-ME08 NOTIFICA DI ESECUZIONE DI SELL-OUT – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail relativo al Comparto Obbligazionario, per le quali verrà eseguito il Sell-Out.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME08

Ader: GKK		Esecuzione Sell-Out		RP-ME08 17 FEB 04 10:04:46 Pag. 1			
Curr: EURO		Comparto Obbligazionario					
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Esecuzione Sell-Out del 17 FEB 04					
Curr: EURO							
Settlement System : 51 ECLR/CEDE							
Si segnala che si è eseguita la procedura di Sell-Out per le seguenti per le seguenti posizioni in fail,.							
Conto: PROPRIO							
ID	ID			Data	Scadenza	Titoli da	
Netta	DVP	Titolo	ISIN	regolamento	fail	ritirare	Controvalore
D4RO3P	1KFNFF	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	16 FEB 04	23 FB 04	50.000	686.450,00 DR

- il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti al Comparto Obbligazionario e al Comparto Obbligazionario ICSD in caso di esecuzione del Sell-Out, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Sell-Out;
- Il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail.
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail doveva essere regolata;
- le colonne "**titoli da consegnare**" e "**titoli da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari da "consegnare" e da "ritirare";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito.

## 2.8.23 RP-ME09 ESITO BUY-IN/PARTICIPANTE IN FAIL - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in stato di esecuzione di Buy-In relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali è avvenuto il riacquisto forzoso nonché il differenziale che il partecipante in fail deve corrispondere a Euronext Clearing.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME09

Ader: GKK		Esito esecuzione Buy-In / partecipante in fail			RP-ME09	26 FEB 04	21:04:46	Pag. 1		
(Comparto Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA										
Conto: TERZI										
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In":										
ID Netta: I114EW		ID DVP: 9HLTL9								
Simb	ISIN	Data regolamento	Data esecuzione buy-in	Titoli da acquistare originariamente	Controvalore originario	Titoli acquistati nei giorni precedenti	Titoli acquistati oggi	Titoli ancora da acquistare	Titoli sottoposti a cash settlement	
MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000	8.400,00 CR	0	700	300	0	
estremi titoli acquistati oggi:										
titolo	Simbolo	ISIN	quantità	controvalore						
Mediaset	MS	IT0001063210	400	3.560,00 DR						
Mediaset	MS	IT0001063210	300	2.700,00 DR						
Totale			700	6.260,00 DR						
Differenziale:										
	MS	IT0001063210	controvalore originario relativo a: 700 titoli: 5.880,00 CR							
	MS	IT0001063210	controvalore acquisti				6.260,00 DR			
		Differenziale	380,00 DR (1)							
Se il differenziale è a debito viene visualizzata la seguente voce:										
(1) Il differenziale verrà addebitato nel regolamento giornaliero entro di domani										
Se il differenziale è a credito viene visualizzata la seguente voce:										
(1) Il differenziale viene trattenuto dalla CC&G										

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni intercorrenti tra l'esecuzione del Buy-In ed il buon fine dello stesso o l'eventuale cash settlement;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;

- la colonna "**titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In;
- la colonna "**controvalore originario**" indica il controvalore originario della posizione in fail;
- la colonna "**titoli acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In;
- la colonna "**titoli acquistati oggi**" indica la quantità di titoli acquistati nella giornata cui si riferisce il report dal Buy-In-Agent;
- la colonna "**titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In;
- la colonna "**titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità non sono stati acquistati dal Buy-In Agent nel tempo previsto e che pertanto sono stati sottoposti, come evidenziato nel report ME09, a cash settlement;
- la sezione "**estremi titoli acquistati oggi**" indica i titoli acquistati dal Buy-In Agent nella giornata nonché il relativo controvalore;
- la sezione "**Differenziale**" illustra il calcolo del differenziale che il partecipante in fail deve alla Euronext Clearing o che la Euronext Clearing trattiene a titolo di commissioni.

## 2.8.24 RP-ME10 ESITO BUY-IN/PARTICIPANTE IN BONIS - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in stato di esecuzione di Buy-In relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali è avvenuto il riacquisto forzoso, nonché i compensi tra Euronext Clearing e il Partecipante in bonis inseriti nella liquidazione netta.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME10

Ader: GKK		Esito esecuzione Buy-In /partecipante in bonis (Comparto Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME10	26 FEB 04	21:04:46 Pag. 1	
Conto: TERZI									
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In":									
ID Netta: FWT3AD		ID DVP: 1KHLPL							
Simb	ISIN	Data regolamento	Data esecuzione buy-in	Titoli da acquistare originariamente	Controvalore originario	Titoli acquistati nei giorni precedenti	Titoli acquistati oggi	Titoli ancora da acquistare	Titoli sottoposti a cash settlement
MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000	8.400,00 CR	0	700	300	0
Compensi inseriti									
Titolo	Simbolo	ISIN	Data eseguito	Data regolamento	Data fine validità	Titoli da ritirare	Controvalore		
Mediaset	MS	IT0001063210	29 FEB 04	2 MAR 04	11 MAR 04	700	5.880,00 DR		

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni intercorrenti tra l'esecuzione del Buy-In ed il buon fine dello stesso o l'eventuale cash settlement;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "**titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In;
- la colonna "**controvalore originario**" indica il controvalore originario della posizione in fail;
- la colonna "**titoli acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In;
- la colonna "**titoli acquistati oggi**" indica la quantità di titoli acquistati nella giornata cui si riferisce il report dal Buy-In-Agent;
- la colonna "**titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In;
- la colonna "**titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità di titoli che per scadenza di termini non saranno acquisiti dal Buy-In Agent e per i quali si procede con il cash settlement;

- la sezione “**compensi inseriti**” indica i compensi Euronext Clearing /Partecipante in bonis che vengono inseriti a seguito degli acquisti effettuati dal Buy-In Agent.

### 2.8.25 RP-ME11 ESITO BUY-IN/PARTECIPANTE IN FAIL - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo al report RP-ME09. In aggiunta a tale report:

- il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell’operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 SecuritiesTarget2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell’operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- In caso di differenziale a debito, è specificato l’importo in euro che Euronext Clearing addebiterà in Target2.

## 2.8.26 RP-ME12 ESITO BUY-IN/PARTECIPANTE IN BONIS-COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo al report RP-ME10. In aggiunta a tale report:

- il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 SecuritiesTarget2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)

## 2.8.27 RP-ME13 CASH SETTLEMENT/PARTICIPANTE IN FAIL - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in stato di esecuzione di Buy-In relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali si provvede alla chiusura mediante cash settlement.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME13

Ader: GKK Cash Settlement Buy-In /partecipante in fail RP-ME13 28 FEB 04 21:04:46 Pag. 1  
(Comparto Azionario e Derivati Azionari)  
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Conto: TERZI

Posizione in stato di "esecuzione Buy-In" chiusa mediante cash settlement

ID Netta: FWT3AD ID DVP: 1KH1PL

Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente precedenti	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni	titoli acquistati oggi	titoli ancora da acquistare	titoli sottoposti a cash settlement
MS	IT0001063210	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	8.400,00 CR	700	0	0	300

Determinazione del cash settlement:

Ammontare A		Ammontare B	
Prezzo riferimento giorno esecuzione	Nr. titoli	Controvalore	Percentuale
9,00	300	2.700,00	10%

Ammontare B		Ammontare A	
Ultimo prezzo riferimento	Nr. titoli	Controvalore	Controvalore originario
8,90	300	2.670,00	2520,00

Cash settlement = 270,00 € DR

Posizione in stato di "esecuzione Buy-In" chiusa mediante cash settlement

ID Netta: FW3BD2 ID DVP: 1KH7GK

Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni precedenti	titoli acquistati oggi	titoli ancora da acquistare	titoli sottoposti a cash settlement
ENI	IT0003132476	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	13.000,00 CR	0	0	0	1000

Determinazione del cash settlement:

Ammontare A		Ammontare B	
Prezzo riferimento giorno esecuzione	Nr. titoli	Controvalore	Percentuale
13,10	1000	13.100,00	10%

Ammontare B		Ammontare A	
Ultimo prezzo riferimento	Nr. titoli	Controvalore	Controvalore originario
13,20	1000	13.200,00	13.000,00

Cash settlement = 1310,00 € DR

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, del giorno nel quale si procede alla chiusura del Buy-In mediante cash settlement;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "**titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In;
- la colonna "**titoli acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In;
- la colonna "**titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In;
- la colonna "**titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità di titoli che per scadenza di termini non saranno acquistati dal Buy-In Agent e per i quali si procede con il cash settlement;
- la sezione "**Determinazione del cash settlement**" illustra il calcolo dell'ammontare del cash settlement.

## 2.8.28 RP-ME14 CASH SETTLEMENT/PARTICIPANTE IN BONIS - COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in stato di esecuzione di Buy-In relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali si provvede alla chiusura mediante cash settlement.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME14

Ader: GKK		Cash Settlement Buy-In /partecipante in bonis					RP-ME14 28 FEB 04 21:04:46 Pag. 1																																																																																
		(Comparto Azionario e Derivati Azionari)																																																																																					
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA																																																																																					
Conto: TERZI																																																																																							
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In" chiusa mediante cash settlement																																																																																							
ID Netta: FWT3AD ID DVP: 1KHLEL																																																																																							
Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni	titoli acquistati oggi precedenti	titoli ancora da acquistare	titoli sottoposti a cash settlement																																																																														
MS	IT0001063210	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	8.400,00 CR	700	0	0	300																																																																														
Determinazione del cash settlement:																																																																																							
<table border="0"> <tr> <td colspan="2">Ammontare A</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Prezzo riferimento giorno esecuzione</td> <td>Nr. titoli</td> <td>Controvalore</td> <td>Percentuale</td> <td colspan="2">Ammontare A</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td>9,00</td> <td>300</td> <td>2.700,00</td> <td>10%</td> <td colspan="2">270,00 €</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td colspan="2">Ammontare B</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Ultimo prezzo riferimento</td> <td>Nr. Titoli</td> <td>Controvalore</td> <td>Controvalore originario</td> <td colspan="2">Ammontare B</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td>8,90</td> <td>300</td> <td>2.670,00</td> <td>2520,00</td> <td colspan="2">150,00 €</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td colspan="11">Cash settlement = 270,00 € DR</td> </tr> </table>											Ammontare A											Prezzo riferimento giorno esecuzione	Nr. titoli	Controvalore	Percentuale	Ammontare A							9,00	300	2.700,00	10%	270,00 €							Ammontare B											Ultimo prezzo riferimento	Nr. Titoli	Controvalore	Controvalore originario	Ammontare B							8,90	300	2.670,00	2520,00	150,00 €							Cash settlement = 270,00 € DR										
Ammontare A																																																																																							
Prezzo riferimento giorno esecuzione	Nr. titoli	Controvalore	Percentuale	Ammontare A																																																																																			
9,00	300	2.700,00	10%	270,00 €																																																																																			
Ammontare B																																																																																							
Ultimo prezzo riferimento	Nr. Titoli	Controvalore	Controvalore originario	Ammontare B																																																																																			
8,90	300	2.670,00	2520,00	150,00 €																																																																																			
Cash settlement = 270,00 € DR																																																																																							
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In" chiusa mediante cash settlement																																																																																							
ID Netta: FW3BD2 ID DVP: 1KH7GK																																																																																							
Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni	titoli acquistati oggi precedenti	titoli ancora da acquistare	tit sottoposti a cash settlement																																																																														
ENI	IT0003132476	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	13.000,00 CR	0	0	0	1000																																																																														
Determinazione del cash settlement:																																																																																							
<table border="0"> <tr> <td colspan="2">Ammontare A</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Prezzo riferimento giorno esecuzione</td> <td>Nr. titoli</td> <td>Controvalore</td> <td>Percentuale</td> <td colspan="2">Ammontare A</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td>13,10</td> <td>1000</td> <td>13.100,00</td> <td>10%</td> <td colspan="2">1310,00 €</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td colspan="2">Ammontare B</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Ultimo prezzo riferimento</td> <td>Nr. titoli</td> <td>Controvalore</td> <td>Controvalore originario</td> <td colspan="2">Ammontare B</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td>13,20</td> <td>1000</td> <td>13.200,00</td> <td>13.000,00</td> <td colspan="2">200,00 €</td> <td colspan="5"></td> </tr> <tr> <td colspan="11">Cash settlement = 1310,00 € DR</td> </tr> </table>											Ammontare A											Prezzo riferimento giorno esecuzione	Nr. titoli	Controvalore	Percentuale	Ammontare A							13,10	1000	13.100,00	10%	1310,00 €							Ammontare B											Ultimo prezzo riferimento	Nr. titoli	Controvalore	Controvalore originario	Ammontare B							13,20	1000	13.200,00	13.000,00	200,00 €							Cash settlement = 1310,00 € DR										
Ammontare A																																																																																							
Prezzo riferimento giorno esecuzione	Nr. titoli	Controvalore	Percentuale	Ammontare A																																																																																			
13,10	1000	13.100,00	10%	1310,00 €																																																																																			
Ammontare B																																																																																							
Ultimo prezzo riferimento	Nr. titoli	Controvalore	Controvalore originario	Ammontare B																																																																																			
13,20	1000	13.200,00	13.000,00	200,00 €																																																																																			
Cash settlement = 1310,00 € DR																																																																																							

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, del giorno nel quale si procede alla chiusura del Buy-In mediante cash settlement;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "**titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In.
- la colonna "**titoli acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In;
- la colonna "**titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In.
- la colonna "**titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità di titoli che per scadenza di termini non saranno acquisiti dal Buy-In Agent e per i quali si procede con il cash settlement;
- la sezione "**Determinazione del cash settlement**" illustra il calcolo dell'ammontare del cash settlement.

### 2.8.29 RP-ME15 CASH SETTLEMENT /PARTECIPANTE IN FAIL - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo al report RP-ME13. In aggiunta a tale report:

- il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 SecuritiesTarget2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE).
- E' indicato nel report l'importo in euro che Euronext Clearing addebiterà in Target2.

### 2.8.30 RP-ME16 CASH SETTLEMENT /PARTECIPANTE IN BONIS - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo al report RP-ME14. In aggiunta a tale report:

- il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- E' indicato nel report l'importo in euro che Euronext Clearing addebiterà in Target2.

## 2.8.31 RP-ME17 ESITO SELL-OUT - COMPARTO AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in stato di esecuzione di Sell-Out relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali è avvenuta la vendita forzata nonché il differenziale che il partecipante in fail deve corrispondere a Euronext Clearing.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME17

Ader: GFK		Esito esecuzione Sell-Out		RP-ME17 17 FEB 04 21:04:46 Pag. 1					
		(Comparto Azionario e Derivati Azionari)		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
Conto: TERZI									
Posizione in stato di "esecuzione Sell-Out":									
ID Netta: I114EW		ID DVP: 9HLTL9							
Simbolo	Data ISIN	Data regolamento	Titoli da esecuzione sell-out	Controvalore vendere originariamente	Titoli originario	Titoli venduti nei giorni	Titoli venduti oggi precedenti	Titoli ancora da vendere	Titoli soggetti a restituzione
MS	IT0001063210	16 FEB 04	17 FEB 04	1.000	8.400,00 DR	0	700	300	0
estremi titoli venduti oggi:									
Titolo	Simbolo	ISIN	Quantità	Controvalore					
Mediaset	MS	IT0001063210	400	3.000,00	CR				
Mediaset	MS	IT0001063210	300	2.000,00	CR				
Totale			700	5.000,00	CR				
Differenziale:									
	MS	IT0001063210	controvalore originario relativo a:		700 titoli: 5.880,00 DR				
	MS	IT0001063210	controvalore vendite differenziale		5.000,00 CR		120,00 DR (1)		
Se il differenziale è a debito viene visualizzata la seguente voce:									
(1) Il differenziale verrà addebitato nel regolamento giornaliero entro domani									
Se il differenziale è a credito viene visualizzata la seguente voce:									
(1) Il differenziale viene trattenuto dalla CC&G									

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti i fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile:
  - la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni del giorno di esecuzione del Sell-Out;
  - il pomeriggio del giorno successivo a quello di esecuzione del Sell-Out;
- la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "**titoli da vendere originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Sell-Out;
- la colonna "**controvalore originario**" indica il controvalore originario della posizione in fail;

- la colonna “**titoli venduti nei giorni precedenti**” indica la quantità di titoli già venduti per il Sell-Out;
- la colonna “**titoli venduti oggi**” indica la quantità di titoli venduti dal Sell-Out-Agent nella giornata cui si riferisce il report;
- la colonna “**titoli ancora da vendere**” indica la quantità di titoli ancora da vendere per completare il Sell-Out;
- la colonna “**titoli sottoposti a cash settlement**” indica la quantità di titoli che il Sell-Out Agent non è riuscito a vendere nel tempo previsto (ore 15.00 di L+2) e che pertanto sono stati sottoposti, come evidenziato nel report ME15, alla chiusura forzata mediante incasso del controvalore da parte di Euronext Clearing e successiva restituzione dei titoli al partecipante in fail;
- la sezione “**estremi titoli venduti oggi**” indica i titoli venduti dal Sell-Out Agent nella giornata nonché il relativo controvalore.
- la sezione “**Differenziale**” illustra il calcolo del differenziale che il partecipante in fail deve alla Euronext Clearing o che la Euronext Clearing trattiene a titolo di commissioni.

### 2.8.32 RP-ME18 ESITO SELL-OUT - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo a report ME17. In aggiunta rispetto a tale report:

- il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione sono indicati in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)
- in caso di differenziale a debito, è specificato l'importo in euro che Euronext Clearing addebiterà in Target2.

## 2.8.33 RP-ME20 COMPENSAZIONE DEI FAILS IN ESECUZIONE DI BUY-IN COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni in fail in stato di esecuzione di Buy-In relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali è stata anticipata la data di fine validità a seguito della richiesta di compensazione da parte del Partecipante.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME20

Gm: BKG	Compensazione dei fails in esecuzione di Buy-In			RP-ME20 18 OTT 10 20:49:51 Pag. 1			
Ader: GKX	(Comparto Azionario e Derivati Azionari)						
	CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Conto: Terzi							
Istruzione di ritiro titoli in stato di "Esecuzione di Buy-In":							
ID CCG Netta	ID CCG DVP	Descrizione	ISIN	Data mancato regolamento	Data fine validità	Titoli originari da ritirare	Controvalore Originario
OPANOG	WKO98B	ETF IEAISH	IE00B3DKX041	7 OTT 10	18 OTT 10	3.000	33.333,00 DR
Istruzione di consegna titoli per la quale è stata anticipata la data di Fine Validità:							
ID CCG Netta	ID CCG DVP	Descrizione	ISIN	Data mancato regolamento	Data fine validità	Titoli originari da consegnare	Controvalore Originario
PA11RO	XN143D	ETF IEAISH	IE00B3DKX041	8 OTT 10	19 OTT 10	4.400	44.400,00 CR
Compensazione delle istruzioni:							
Descrizione	ISIN	Data esecuzione Compensazione	Quantità titoli compensata	Controvalori Titoli compensati			
ETF IEAISH	IE00B3DKX041	18 OTT 10	3.000	33.333,00	DR		
			3.000	30.027,27	CR		
				3.060,23	DR		
Il Differenziale di contante di euro 3.060,23 sarà riscosso nell'ambito del "Regolamento giornaliero" del 19 OTT 10 (del giorno di CC&G aperta successivo a quello in cui la compensazione è stata eseguita)							
Istruzione reinserita nel ciclo lordo di liquidazione o in esecuzione di Buy-In per la seguente quantità Titoli e controvalore:							
Descrizione	ISIN	Data regolamento fine validità	Data residui	Quantità titoli Titoli residui	Controvalori		
ETF IEAISH	IE00B3DKX041	18 OTT 10	19 OTT 10	1.400	14.372,73	CR	

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari che richiedono la compensazione delle posizioni in fail ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni del giorno successivo a quello di esecuzione della compensazione delle posizioni contrattuali in fail.
- la colonna "ID CCG netta" indica l'istruzione netta di Euronext Clearing;
- la colonna "ID CCG DVP" indica l'istruzione lorda di Euronext Clearing;

- la colonna "**descrizione**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail. I fail potrebbe essersi generato da posizioni relative sia al Comparto Azionario sia al Comparto Derivati Azionari;
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**data mancato regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "**data fine validità**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail doveva essere regolata;
- la colonna "**data esecuzione compensazione**" indica la data nella quale viene effettuata la compensazione delle posizioni contrattuali in fail;
- le colonne "**titoli originari da consegnare**" e "**titoli originari da ritirare**" indicano rispettivamente l'ammontare degli strumenti finanziari da "consegnare" e da "ritirare";
- la colonna "**quantità titoli compensata**" indica l'ammontare dei titoli oggetto di compensazione;
- la colonna "**controvalore originario**" indica il controvalore originario in euro degli strumenti finanziari da "consegnare" o "ritirare". "CR" indica che il Partecipante è a credito; "DR" indica che il Partecipante è a debito;
- la colonna "**controvalori titoli compensati**" indica i controvalori in euro delle posizioni oggetto di compensazione in consegna e in ritiro e il differenziale tra i due controvalori;
- la colonna "**data regolamento compensazione**" indica la data entro la quale la posizione residua dall'operazione di compensazione deve essere regolata;
- la colonna "**quantità titoli residui**" indica la quantità dei titoli corrispondenti all'istruzione reinserita nel ciclo lordo di liquidazione ovvero in esecuzione di Buy-In dopo la compensazione;
- la colonna "**controvalori titoli residui**" indica il controvalore in euro dei titoli reinseriti nel ciclo lordo di liquidazione (Partecipante *in malis*) ovvero in esecuzione di Buy-In dopo la compensazione (Partecipante *in bonis*).

## 2.8.34 RP-ME21 COMPENSAZIONE DEI FAILS IN ESECUZIONE DI BUY-IN – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo a report ME20

## 2.8.35 RP-ME25 ESECUZIONE BUY-IN/PARZIALIZZAZIONE – COMPARTO AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta le informazioni relative alla Posizione in stato di esecuzione di Buy-In relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari, il compenso inserito da Euronext Clearing in favore del Partecipante In Bonis a seguito della Consegna Parziale e il dettaglio dei titoli ancora da ritirare.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME25

Ader: GKK		Esecuzione Buy-In/Parzializzazione			RP-ME25	4 FEB 10	21:02:27	Page	
Comparto Azionario BIT e Derivati Azionari CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA									
Conto: Terzi									
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In":									
Id.Netta COG: EK&WT1		Id.DVP COG: 9SJA1G							
Simb	ISIN	Data regolame.	Data esecuzione buy-in	Titoli da acquistare originariamente	Controvalore originario	Titoli acquistati nei giorni precedenti	Titoli acquistati oggi	Titoli ancora da acquistare	Titoli sottoposti a cash settlement
QFI	IT0003242598	26 GEN 10	04 FEB 10	18,00	2.839,86 DR	0,00	10,00	8,00	0,00
Compenzi inseriti nel ciclo netto notturno:									
ISIN	Data eseguito	Data regolamento	Data fine validità	Titoli da ritirare	Controvalore				
IT0003242598	04 FEB 10	09 FEB 10	18 FEB 10	10,00	1.577,70 DR				

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, del giorno successivo alla data di fine validità.
- la colonna "**Simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- la colonna "**Data esecuzione buy-in**" indica la data in cui è stata attivata la procedura di esecuzione di buy-in;
- la colonna "**Titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In;
- la colonna "**Controvalore originario**" indica il controvalore originario della posizione in fail;
- la colonna "**Acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In o parzialmente consegnati;
- la colonna "**Titoli acquistati oggi**" indica la quantità di titoli acquistati nella giornata cui si riferisce il report dal Buy-In-Agent;
- la colonna "**Titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In;

- la colonna "**Titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità di titoli che non sono stati acquistati dal Buy-In Agent nel tempo previsto e che pertanto sono stati sottoposti, come evidenziato nel report ME09, a cash settlement;
- la sezione "**Compensi inseriti** " indica i compensi Euronext Clearing /Partecipante in bonis che vengono inseriti a seguito di consegne parziali.

### 2.8.36 RP-ME26 ESECUZIONE BUY-IN/PARZIALIZZAZIONE - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO

Analogo al report ME25. In aggiunta rispetto a tale report:

- per il Comparto Obbligazionario ICSD è indicato il sistema di settlement e la valuta di riferimento dell'operazione in alto a sinistra;
- le colonne **ID Netta** e **ID DVP** indicano i codici identificativi di Target2 Securities.
- la colonna **ID CCG** indica il TRN dell'operazione in caso di sistema di settlement Euroclear o Clearstream (ECLR/CEDE)

## 2.8.37 RP-ME40 PROROGA DATA FINE VALIDITÀ PARTECIPANTE DIRETTO/COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali sia stata prorogata la data di fine validità sia per il Partecipante in fail sia per il Partecipante in bonis.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME40

Ader: GKK		Proroga Data Fine Validità Partecipante Diretto (Comparti Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME40 7 JUN 17 11:47:39 Page 1			
Settlement System : 60 T2S									
Valuta: EUR - EURO									
Istruzioni a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare									
Conto: Terzi									
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Regolamen	Data Fine Val	Nuova In fail	Posizioni Controvalore		Stato
GTXOS	1705290574581929	GENERALI	IT0000062072	01 JUN 17	14 JUN 17	100,00	1.590,00		BONIS
OGIXY9	1705290574581780	CAIRO COMMUNICATION	IT0004329733	01 JUN 17	14 JUN 17	9,00	25,22		MALIS

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni successivi all'originaria data di fine validità della posizione contrattuale non regolata;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Nuova Fine Val**" indica la data di Fine Validità modificata entro la quale la **posizione dovrà essere regolata per non andare in esecuzione forzata**;
- la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.38 RP-ME41 PROROGA DATA FINE VALIDITÀ PARTECIPANTE DIRETTO/COMPARTI OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD per le quali sia stata prorogata la data di fine validità sia per il Partecipante in fail sia per il Partecipante in bonis.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME41

Ader: GKK		Proroga Data Fine Validità Partecipante Diretto (Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME41 7 JUN 17 11:47:39 Page 1			
Settlement System : 51 ICSD ECLR/CEDE									
Valuta: EUR - EURO									
Istruzioni a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare									
Conto: Terzi									
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data Regolamen	Nuova Fine Val	Posizioni In fail	Controvalore	Stato	
AGKLZS	20170522AGKLZS01	BELGIUM TF 4% MZ32	BE0000326356	24 MAY 17	14 JUN 17	1.000,00	1.409,73	MALIS	
AGKLOB	20170522AGKLOB01	BNP FORTIS 5.757% S	BE0933514839	24 MAY 17	14 JUN 17	5.000.000,00	5.322.885,00	BONIS	

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni successivi all'originaria data di fine validità della posizione contrattuale non regolata;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Nuova Fine Val**" indica la data di Fine Validità modificata entro la quale la **posizione dovrà essere regolata per non andare in esecuzione forzata**;
- la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.39 RP-ME42 PROROGA DATA FINE VALIDITÀ PARTECIPANTE GENERALE/COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato, di competenza del Partecipante Generale, riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari per le quali sia stata prorogata la data di fine validità tanto per i relativi Clienti Negoziatori in fail quanto per i Clienti Negoziatori in bonis.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME42

GCM: GKK		Proroga Data Fine Validità Partecipante Generale (Comparti Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME42 7 JUN 17 11:47:39 Page 1					
Settlement System : 60 T2S Valuta: EUR - EURO											
Istruzioni a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare											
Conto: Terzi											
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data		Nuova In fail	Posizioni	Controvalore	Member	C/H	Stato
				Regolamen	Fine Val						
GISCS	3705290574581929	GENERALI	IT0000062072	01 JUN 17	14 JUN 17	200,00		2.590,00	BBBB	C	BONIS
OGSXY9	3705290574581780	CAIRO COMMUNICATION	IT0004329733	01 JUN 17	14 JUN 17	19,00		125,22	ABCD	H	MALIS

- il tabulato viene prodotto per i Partecipanti Generali e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti e riporta la posizione dei relativi Clienti Negoziatori in fail ed i Clienti Negoziatori in bonis ai Comparti Azionario e Derivati Azionari. Il report è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni successivi all'originaria data di fine validità della posizione contrattuale non regolata;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Nuova Fine Val**" indica la data di Fine Validità modificata entro la quale la **posizione dovrà essere regolata per non andare in esecuzione forzata**;
- la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Member**" indica il codice mnemonico del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**C/H**" indica il conto Proprio ovvero il conto Terzi del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.40 RP-ME43 PROROGA DATA FINE VALIDITÀ PARTECIPANTE GENERALE/COMPARTI OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato, di competenza del Partecipante Generale, riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD per le quali sia stata prorogata la data di fine validità tanto per i relativi Clienti Negoziatori in fail quanto per i Clienti Negoziatori in bonis.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME43

GCM: GKK		Proroga Data Fine Validità Partecipante Generale (Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD)				RP-ME43 7 JUN 17 11:47:39 Page 1				
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA										
Settlement System : 51 ICSD ECLR/CEDE										
Valuta: EUR - EURO										
Istruzioni a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare										
Conto: Terzi										
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data Regolamen	Nuova Fine Val	Posizioni In fail	Controvalore	Member	C/H	Stato
AGJIFS	20170407AGJIFS01	BUND LUG39 EUR 4,	DE0001135325	24 MAY 17	14 JUN 17	1.000,00	1.717,25	ABCD	H	MALIS
AGJIFT	20170407AGJIFT01	BUND LUG39 EUR 4,	DE0001135325	24 MAY 17	14 JUN 17	1.000,00	1.717,25	BBBB	C	BONIS

- il tabulato viene prodotto per i Partecipanti Generali e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti e riporta la posizione dei relativi Clienti Negoziatori in fail ed i Clienti Negoziatori in bonis ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD. Il report è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni successivi all'originaria data di fine validità della posizione contrattuale non regolata;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Nuova Fine Val**" indica la data di Fine Validità modificata entro la quale la **posizione dovrà essere regolata per non andare in esecuzione forzata**;
- la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Member**" indica il codice mnemonico del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**C/H**" indica il conto Proprio ovvero il conto Terzi del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.41 RP-ME44 ISTRUZIONI IN ESECUZIONE DI BUY IN PARTECIPANTE DIRETTO/COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari giunte a data di fine validità che, a chiusura dell'ultimo ciclo di regolamento disponibile, sia per il Partecipante in fail sia per il Partecipante in bonis, siano state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione di Buy In.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME44

Ader: GKK		Istruzioni In Esecuzione di Buy In Partecipante Diretto				RP-ME44 7 JUN 17 11:47:39 Page 1			
(Comparti Azionario e Derivati Azionari)									
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA									
Settlement System : 60 T2S									
Valuta: EUR - EURO									
Istruzioni che al termine della giornata sono state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione di Buy In									
Conto: Proprio									
				Data		Posizioni			
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Regolamen	Fine Val	In fail	Controvalore	Stato	
OGTCEX	1705230571624447	SOGEFI	IT0000076536	01 JUN 17	07 JUN 17	1.531,00	2.532,27	BONIS	
OGUPSN	1705230571626260	POLIGRAFICI EDIT	IT0000086923	01 JUN 17	07 JUN 17	0,00	0,65	BONIS	
OGUKLN	1705230571625813	BUZZI UNICEM ORD.	IT0001347308	01 JUN 17	07 JUN 17	9.960,00	23.007,60	MALIS	

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipante in fail e per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari. Il report è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Fine Val**" indica la data di Fine Validità della **posizione oltre la quale si procede con l'esecuzione forzata**;
- la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.42 RP-ME45 ISTRUZIONI IN ESECUZIONE DI BUY IN PARTECIPANTE DIRETTO/COMPARTI OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD giunte a data di fine validità che, a chiusura dell'ultimo ciclo di regolamento disponibile, sia per il Partecipante in fail sia per il Partecipante in bonis, siano state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione di Buy In.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME45

Ader: GKK		Istruzioni In Esecuzione di Buy In Partecipante Diretto					RP-ME45 7 JUN 17 11:47:39 Page 1		
(Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD)									
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA									
Settlement System : 51 ICSD ECLR/CEDE									
Valuta: EUR - EURO									
Istruzioni che al termine della giornata sono state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione									
Conto: Proprio									
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data		Posizioni		Controvalore	Stato
				Regolamen	Fine Val	In fail			
AGKPPB	20170524AGKPPB01	BELGIUM TF 3,75%	BE0000331406	24 MAY 17	07 JUN 17	5.000,00		7.903,10	BONIS
AGKPPS	20170524AGKPPS01	BELGIUM TF 3,75%	BE0000331406	24 MAY 17	07 JUN 17	5.000,00		7.903,10	MALIS
AGKPOB	20170524AGKPOB01	BNP FORTIS 5.757%	BE0933514839	24 MAY 17	07 JUN 17	500.000,00		532.446,20	BONIS
AGKPTB	20170524AGKPTB01	KFW MZ19 EUR 1,87	DE000A1MBB62	24 MAY 17	07 JUN 17	1.000,00		1.031,54	BONIS
AGKPTS	20170524AGKPTS01	KFW MZ19 EUR 1,87	DE000A1MBB62	24 MAY 17	07 JUN 17	1.000,00		1.031,54	MALIS
AGKPVB	20170524AGKPVB01	DAIMLER TF 1,5% M	DE000A2AAL31	24 MAY 17	07 JUN 17	1.000,00		1.043,02	BONIS
AGKFWB	20170524AGKFWB01	COMMERZBANK 7.75%	DE000CB83CF0	24 MAY 17	07 JUN 17	100.000,00		101.495,07	BONIS

- il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipante in fail e per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Fine Val**" indica la data di Fine Validità della **posizione oltre la quale si procede con l'esecuzione forzata**;
- la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";

- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.43 RP-ME46 ISTRUZIONI IN ESECUZIONE DI BUY IN PARTECIPANTE GENERALE/COMPARTI AZIONARIO E DERIVATI AZIONARI

Il tabulato, di competenza del Partecipante Generale, riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari giunte a data di fine validità che, a chiusura dell'ultimo ciclo di regolamento disponibile, tanto per i relativi Clienti Negoziatori in fail quanto per i Clienti Negoziatori in bonis, siano state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione di Buy In.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME46

GCM: GKK		Istruzioni In Esecuzione di Buy In Partecipante Generale (Comparti Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME46 7 JUN 17 11:47:39 Page 1				
Settlement System : 60 T2S										
Valuta: EUR - EURO										
Istruzioni che al termine della giornata sono state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione										
Conto: Terzi										
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data Regolamen	Fine Val	Posizioni In fail	Controvalore	Member	C/H	Stato
OGUESR	1705230571625814	AEFFE	IT0001384590	01 JUN 17	07 JUN 17	99,00	89,10	ABCD	C	BONIS
OGUE57	1705230571624495	ENEL	IT0003128367	01 JUN 17	07 JUN 17	41.167,00	47.837,47	ABCD	H	BONIS
OGUQOL	1705230571625801	TERNA	IT0003242622	01 JUN 17	07 JUN 17	10,00	50,30	BBEB	H	BONIS

- il tabulato viene prodotto per i Partecipanti Generali e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti e riporta la posizione dei relativi Clienti Negoziatori in fail ed i Clienti Negoziatori in bonis ai Comparti Azionario e Derivati Azionari. Il report è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Fine Val**" indica la data di Fine Validità della **posizione oltre la quale si procede con l'esecuzione forzata**;
- **la colonna "Posizioni In fail"** indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Member**" indica il codice mnemonico del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**C/H**" indica il conto Proprio ovvero il conto Terzi del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.44 RP-ME47 ISTRUZIONI IN ESECUZIONE DI BUY IN PARTECIPANTE GENERALE/COMPARTI OBBLIGAZIONARIO E OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato, di competenza del Partecipante Generale, riporta l'elenco delle posizioni relative ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD giunte a data di fine validità che, a chiusura dell'ultimo ciclo di regolamento disponibile, tanto per i relativi Clienti Negoziatori in fail quanto per i Clienti Negoziatori in bonis, siano state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione di Buy In.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-ME47

GCM: GKK		Istruzioni In Esecuzione di Buy In Partecipante Generale (Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME47 7 JUN 17 11:47:39 Page 1				
Settlement System : 51 ICSD ECIR/CEDE										
Valuta: EUR - EURO										
Istruzioni che al termine della giornata sono state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione										
Conto: Terzi										
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data Regolamen	Nuova Fine Val	Posizioni In fail	Controvalore	Member	C/H	Stato
DDJIFS	20170407DDJIFS01	BUND LUG39 EUR 4,	DE0001135325	24 MAY 17	07 JUN 17	3.000,00	3.317,25	ABCD	H	MALIS
DDJIPT	20170407DDJIPT01	BUND LUG39 EUR 4,	DE0001135325	24 MAY 17	07 JUN 17	7.000,00	7.777,25	BBEB	C	BONIS

- il tabulato viene prodotto per i Partecipanti Generali e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti e riporta la posizione dei relativi Clienti Negoziatori in fail ed i Clienti Negoziatori in bonis ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD. Il report è disponibile la mattina;
- la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- la colonna "**Fine Val**" indica la data di Fine Validità della **posizione oltre la quale si procede con l'esecuzione forzata**;
- la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- la colonna "**Member**" indica il codice mnemonico del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**C/H**" indica il conto Proprio ovvero il conto Terzi del Cliente Negoziatore;
- la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a Euronext Clearing "Malis" ovvero in ritiro da Euronext Clearing "Bonis".

## 2.8.45 RP-MD21 PARZIALIZZAZIONE E SPLITTING - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta le informazioni relative alla parzializzazione ed allo splitting per il comparto obbligazionario ICSD.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MD21

Ader: GKK		Parzializzazioni giornaliere ICSD RP-MD21 17LUG12 15:10:00 Pag. 1					
		Comparto obbligazionario- ICSD					
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Parzializzazioni del: 17LUG12					
Si informa che CC&G ha effettuato le seguenti parzializzazioni:							
ISIN: EU000AIGQAB4		EFSF IG21 EUR 3,375					
TRN ORIGINALE: 2012072000ABCN01		Data	Scadenza	Titoli da	Titoli da		
	Tipo	regolamento	fail	consegnare	ricevere	Controvalore	Val
ISTRUZIONE PARZIALE	TRN						
ISTRUZIONE PARZIALE	2012072000ABC1H1	I	18LUG12	01AUG12	0	5.000.000	5.005.000,25 EUR
ISTRUZIONE PARZIALE	2012072000ABC2H1	I	18LUG12	01AUG12	0	5.000.000	5.005.000,25 EUR
ISTRUZIONE CANCELLATA	2012072000ABC3H1	C	18LUG12	01AUG12	0	10.000.000	10.010.000,50 EUR
ISIN: DE000A0GT0B9		Deutsche Tel					
TRN ORIGINALE: 2012072000001N01		Data	Scadenza	Titoli da	Titoli da		
	Tipo	regolamento	fail	consegnare	ricevere	Controvalore	Val TRN
ISTRUZIONE PARZIALE	20120720000011P1	I	17LUG12	31LUG12	0	70.000	70.086,26 EUR
ISTRUZIONE PARZIALE	20120720000012P1	I	17LUG12	31LUG12	0	30.000	30.036,97 EUR
ISTRUZIONE CANCELLATA	20120720000013P1	C	17LUG12	31LUG12	0	100.000	100.123,23 EUR

- In caso di consegna parziale da parte di Euronext Clearing al Partecipante o ad un suo Settlement Agent di titoli oggetto di un'istruzione in fail, il report contiene informazioni riguardanti l'istruzione in fail oggetto di consegna parziale e soggetta a cancellazione:
  - Isin
  - Descrizione titolo
  - Codice identificativo dell'istruzione originaria (TRN originale)
- Il report, a seguire, riporta le informazioni relative all'istruzione di cancellazione e alle istruzioni inserite. I dettagli riportati nel report sono i seguenti:
  - Codice identificativo dell'istruzione (TRN)
  - Tipo di istruzione: cancellata o inserita
  - Data Regolamento – la data regolamento delle istruzioni inserite è equivalente alla data di regolamento dell'istruzione originaria
  - Scadenza fail – per scadenza fail si intende la data di fine validità dell'istruzione
  - Titoli da consegnare – quantità titoli o valore nominale dell'istruzione inserita/cancellata se si tratta di un'istruzione in consegna
  - Titoli da ricevere - quantità titoli o valore nominale dell'istruzione inserita/cancellata se si tratta di un'istruzione in ritiro
  - Controvalore – controvalore dell'operazione; in caso di istruzioni inserite, il controvalore sarà calcolato in maniera proporzionale rispetto al controvalore dell'istruzione originaria

- Valuta

#### 2.8.46 RP-MD22 PARZIALIZZAZIONE - COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD PER AGENTE DI REGOLAMENTO

Il report contiene le stesse informazioni fornite dal report MD21 e riporta il nome dell'Agente di Regolamento in alto a sinistra.

## 2.9 Sezione IX: Penali di Settlement

### 2.9.1 RP-MS54 PENALI – IMPORTI NETTI MENSILI

Il tabulato MS54 contiene le informazioni relative al saldo netto mensile delle penali di settlement. E' prodotto per il Partecipante Generale e per ogni Cliente Negoziatore del suo conto Terzi Omnibus. ed è disponibile il 15° giorno di Euronext Clearing aperta del mese successivo al mese di riferimento.

#### ESEMPIO TABULATO RP-MS54

Ader: BANC	Penali - Importo netto Mensile MS54	20 APR 21	00:38:53
GCM: BANF			
MBR: AAB			
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA			
Periodo Penali: 1 MARZO 2021 - 31 MARZO 2021			
Data di regolamento: <b>26 APRIL 2021</b>			
Sistema di liquidazione: MOTI			
Valuta: EUR - EURO			
		Conto proprio	Conto Terzi
Importo netto penali		6.200,00DR	2.850,00 CR
Importo CCP Mismatch		1,20DR	0,10DR
Importo finale saldo		6.201,20DR	2.849,90DR
		-----	-----
Sistema di liquidazione: ECLR/CEDE			
Valuta: EUR - EURO			
		Conto proprio	Conto Terzi
Importo netto penali		1.582,40CR	350,00 CR
Importo CCP Mismatch		4,50DR	1,80DR
Importo finale saldo		1.577,90CR.....	348,20CR

- Alla voce **Importo netto penali** è indicato l'ammontare totale delle penali del mese di riferimento per il corrispondente Sistema di Liquidazione;
- La voce **Importo CCP Mismatch** è relativa agli sbilanci della CCP rispetto alle penali totali da raccogliere e da redistribuire. L'importo è calcolato per ogni Partecipante/conto/Sistema di Liquidazione in proporzione alle relative penali a credito.
- La voce **Importo finale saldo** è la somma dell'importo netto penali e dell'importo mismatch.

## 2.9.2 RP-MS55 PENALI – IMPORTI NETTI MENSILI PER PARTECIPANTE DIRETTO

Il tabulato MS55 è prodotto per tutti i Partecipanti Diretti e per i loro conti segregati (ISA, AOA, GOSA e NOSA), è disponibile il 15° giorno di Euronext Clearing aperta del mese successivo a quello di riferimento e riporta gli importi netti relativi alle penali da regolare tramite addebito diretto sul conto PM in Target2 il 17° giorno del mese successivo a quello di riferimento.

### ESEMPIO TABULATO RP-MS55

Penali - Importo netto Mensile MS55 RP-MS55 20 APR 21 00:38:53		
GCM:BANF		
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		
Periodo Penali: 1 MARZO 2021 - 31 MARZO 2021		
Data di regolamento: <b>26 APRIL 2021</b>		
Sistema di liquidazione: MOTI		
Valuta: EUR - EURO		
	Conto Proprio	Conto terzi
Importo netto penali in pagamento	2.850,00 CR	6.200,00 DR
Importo CCP Mismatch	1,20DR	0,10DR
Importo finale saldo	2.848,80DR	6.199,90DR
Sistema di liquidazione: ECLR/CEDE		
Valuta: EUR - EURO		
	Conto Proprio	Conto terzi
Importo netto penali in pagamento	1.582,40CR	50,00 CR
Importo CCP Mismatch	4,50DR	1,80DR
Importo finale saldo	1.577,90CR	48,20CR

- Alla voce **Importo netto penali in pagamento** è indicato l'ammontare totale delle penali del mese di riferimento calcolate sul conto per Sistema di Liquidazione;
- La voce **Importo CCP Mismatch** è relativa agli sbilanci della CCP rispetto alle penali totali da raccogliere e da redistribuire. L'importo è calcolato per ogni Partecipante/conto/Sistema di Liquidazione in proporzione alle relative penali a credito.
- La voce **Importo finale saldo** è la somma dell'importo netto penali e dell'importo mismatch.

## 2.10 Sezione X: Basilea III – Asset Class

### 2.10.1 RP-MB02 EQUITY DERIVATES ASSET CLASS

Il tabulato riporta le informazioni relative al Comparto Derivati su Equity.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MB02

Mbr: XXXXXXXX			
Basilea III - Equity Deriv. asset class RP-MB02 1 JUN 21 14:45:05 Page 1			
Update at: 31 MAY 21			
Equity Derivatives asset class			
Ref:	Basel Parameter	Description	Value
01	KCCP	Hypothetical capital of the CCP	3.147.676,62
02	DFCM	Sum of clearing members' pre-funded default fund contributions	2.906.926.999,52
03	DFCCP	Total amount of the CCP's own pre-funded financial resources that it is required to use to cover its losses following the default of one or more of its clearing members before using the default fund contributions of the remaining clearing members	8.951.578,91
04	DFcCM	Sum of clearing members' contractually committed default fund contributions	4.360.390.499,28
05	Initial margin	Total amount of initial margin	3.952.478.487,97
06	C-FACTOR	C-Factor	0,16 %

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Derivati su Equity ed è disponibile entro il quinto giorno lavorativo successivo alla data di calcolo di fine mese.
- Alla voce "**KCCP**:" viene indicato il capitale teorico della CCP relativo al Comparto.
- Alla voce "**DFCM**:" viene indicata la somma dei contributi prefinanziati versati dai Partecipanti come quota di contribuzione al default fund del Comparto.
- Alla voce "**DFCCP**:" viene indicato l'ammontare totale delle risorse finanziarie stanziato dalla CCP ("Skin In the Game") relative al Comparto.
- Alla voce "**DFcCM**:" viene indicata la somma dei contributi non prefinanziati che potrebbero essere richiesti ai Partecipanti come quota di contribuzione al default fund del Comparto.
- Alla voce "**Initial Margin**:" viene indicata la somma totale degli Initial Margin calcolati per il Comparto.
- Alla voce "**C-FACTOR**:" viene indicato il coefficiente usato dal Partecipante Generale/Individuale del Comparto, per calcolare il requisito di capitale a fronte dell'esposizione al rischio di controparte nei confronti della CCP.

## 2.10.2 RP-MB04 BOND ASSET CLASS

Il tabulato riporta le informazioni relative al Comparto Repo.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MB04

Mbr: XXXXXXXX			
Basilea III - BOND asset class			
RP-MB04			
1 JUN 21 14:45:05 Page 1			
Update at: 31 MAY 21			
Repo and Reverse Repo Transactions asset class			
Ref:	Basel Parameter	Description	Value
01	KCCP	Hypothetical capital of the CCP	1.176.617,52
02	DFCM	Sum of clearing members' pre-funded default fund contributions	3.617.812.379,73
03	DFCCP	Total amount of the CCP's own pre-funded financial resources that it is required to use to cover its losses following the default of one or more of its clearing members before using the default fund contributions of the remaining clearing members	11.219.433,64
04	DFcCM	Sum of clearing members' contractually committed default fund contributions	5.426.718.569,59
05	Initial margin	Total amount of initial margin	8.149.078.651,36
06	C-FACTOR	C-Factor	0,16 %

- Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Repo ed è disponibile entro il quinto giorno lavorativo successivo alla data di calcolo di fine mese.
- La descrizione delle voci dei campi è analoga a quella riportata nel paragrafo RP-MB02 Equity Derivates asset class

## 2.11 Sezione XI: Corporate Actions

### 2.11.1 RP-MS18 ISTRUZIONI DI CONTANTE – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta le informazioni relative alle compensazioni dovute ad interventi di rettifica delle Posizioni Contrattuali.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS18

Ader: GKK		Cash Transfer		RP-MS18	9 DEC 13	11:58:10	1
		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
		Contrattazioni del: 09 DEC 13					
	ISIN	TRN	Note	Controvalore			
Valuta: EUR							
Conto: C Terzi							
	CORPORATE ACTION	DE000A0GTCB9 DT INT FIN 05/2	2013100200023N01		325,00	DB	
PD=Payment date		CCSD=Coupon Comp. Settlem. Date	:				
CSD=Contractual Settlement Date:	02/12/2013	ASD=Actual Settlement Date	:				
CVD=Coupon Value Date:	09/12/2013	RD/RPD=Record Date/Redemption Payment Date	:29/11/2013				
IPED=Interest Period Ending Date:		Tasso Interesse	:				
CCV=Coupon Compensation Value Date :	Nominal Value		:				
				Importo a Credit	10.325,00	CR	
Valuta: USD							
Conto: C Terzi							
	CORPORATE ACTION	DE000A0GTCB9 DT INT FIN 05/2	2013100200034N01		500,00	DB	
PD=Payment date		CCSD=Coupon Comp. Settlem. Date	:				
CSD=Contractual Settlement Date:	02/12/2013	ASD=Actual Settlement Date	:				
CVD=Coupon Value Date:	09/12/2013	RD/RPD=Record Date/Redemption Payment Date	: 29/11/2013				
IPED=Interest Period Ending Date:		Tasso Interesse	:				
CCV=Coupon Compensation Value Date :	Nominal Value		:				
				Importo a Debito	500,00	DB	
Conto: F Proprio							
	REDEMPTION	DE000A0GTCB9 DT INT FIN 05/2	2013100200056N01		225,00	CR	
PD=Payment date		CCSD=Coupon Comp. Settlem. Date	:				
CSD=Contractual Settlement Date:	02/12/2013	ASD=Actual Settlement Date	:				
CVD=Coupon Value Date:	09/12/2013	RD/RPD=Record Date/Redemption Payment Date	: 29/11/2013				
IPED=Interest Period Ending Date:		Tasso Interesse	:				
CCV=Coupon Compensation Value Date :	Nominal Value		:				
				Importo a Credito	225,00	CR	

- Il report è prodotto in tempo reale a partire del momento in cui l'istruzione risulta eligibile e ogni volta che le informazioni in esso contenute si aggiornino.
- alla voce "valuta" è indicata la valuta di regolamento della compensazione di contante (valuta di regolamento);
- alla voce "conto" è riportato il conto del Partecipante (proprio/terzi);
- la colonna "ISIN" indica l'ISIN dello strumento finanziario;
- la colonna "TRN" indica il TRN dell'istruzione;

- la colonna "Note" riporta eventuali informazioni aggiuntive sull'operazione;
- la colonna "Controvalore" indica l'importo a debito/credito del Partecipante.
- La causale dell'istruzione, indicata prima dell'ISIN , può contenere le seguenti fattispecie :
  - Corporate Action: in caso di compensazione dovuta a interventi di rettifica;
  - Redemption: in caso di compensazione dovuta a rimborso.

A seconda di quale evento generi l'Istruzione di contante, il report riporta le seguenti informazioni:

- CCSD (Coupon Compensation Settlement Date): Giorno in cui si effettua la compensazione
- PD (Payment Date) : Giorno in cui si effettua il pagamento
- Nominal Value: valore nominale del trade
- CCV (Coupon Compensation Value): Data valuta della compensazione
- CSD (Contractual Settlement Date): Intended Settlement Date dell'istruzione
- ASD (Actual Settlement Date): Data di regolamento effettiva dell'istruzione
- IPED (Interest Period Ending Date): Ultimo giorno di maturazione degli interessi
- CVD (Coupon Value Date): Data valuta del pagamento del coupon

## 2.11.2 RP-MS21 ISTRUZIONI DI CONTANTE S.A. – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta le informazioni per gli Agenti di Regolamento relative alle compensazioni dovute ad interventi di rettifica delle Posizioni Contrattuali dei Partecipanti.

Il report riporta in ciascuna pagina le informazioni relative ad un singolo Partecipante indicato in alto a sinistra.

Per una descrizione del contenuto del report, si prega di fare riferimento al report MS18.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS21

Dlv: GKK	Cash Transfe	RP-MS21	9 DEC 13	11:58:10	1
Mor: Akk	CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia				
	Contrattazioni del: 09 DEC 13				
	ISIN	TRN	Note	Controvalore	
-----					
Valuta: EUR					
Conto: C Terzi					
	CORPORATE ACTION DE000A0GTCB9 DT INT FIN 05/2	2013100200012N01		10.000,00 DB	
PD=Payment date	: 09/12/2013	CCSD=Coupon Comp. Settlement Date:		09/12/2013	
CSD=Contractual Settlement Date	: 02/12/2013	ASD=Actual Settlement Date		02/12/2013	
CVD=Coupon Value Date	: 09/12/2013	RD/RPD=Record Date/Redemption Payment Date		29/11/2013	
IPED=Interest Period Ending Date	: 09/12/2013	Tasso Interesse:			
CCV=Coupon Compensation Value Date	:	Nominal Value	:		
				-----	
		Importo a Debito		10.000,00 DB	

### 2.11.3 RP-MS38 SALDI COUPON COMPENSATION – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle compensazioni, dovute ad interventi di rettifica delle Posizioni Contrattuali, per le quali è stato generato un saldo. Il report riporta l'importo del saldo (previsionale/definitivo) e gli importi delle compensazioni sottostanti il saldo.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS38

Mor: AKK		Balances Coupon Compensatio		RP-MS38	24 OCT'18	19:51:28	1
		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
Account :	xxxxx						
Currency:	USD USD - U.S. DOLLAR						
Causal :	CA CORPORATE ACTION						
Mor	Isin	Trn	CVD Date	ASD Date	Provisional Amount	Definitive Amount	Total Amount
AKK	US912828TS94	20170330BGJECJP1	31/03/2017	7/04/2017		468,75 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJECMP1	31/03/2017	10/04/2017		8.509,38 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJECGP1	31/03/2017	6/04/2017		2.093,75 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJECDP1	31/03/2017	5/04/2017		103,13 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJECOP1	31/03/2017	4/04/2017		1.343,75 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJEC4P1	31/03/2017	31/03/2017		468,75 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJEC7P1	31/03/2017	3/04/2017		518,75 D	
Totals					25.118,75 D	13.506,26 D	38.625,01 D

- alla voce "currency" è indicata la valuta di regolamento della compensazione di contante (valuta di regolamento);
- alla voce "account" è riportato il conto del Partecipante (proprio/terzi);
- la voce "MBR" indica il Partecipante soggetto a Coupon Compensation
- la colonna "ISIN" indica l'ISIN dello strumento finanziario;
- la colonna "TRN" indica il TRN dell'istruzione;

A seconda di quale evento generi l'Istruzione di contante, il report riporta le seguenti informazioni

- CVD (Coupon Value Date): Data valuta del pagamento del coupon
- ASD (Actual Settlement Date): Data di regolamento effettiva dell'istruzione
- Provisional Amount: indica l'importo del saldo previsionale. Il saldo è previsionale quando non tutte le compensazioni sottostanti sono eligibili per il pagamento (Le compensazioni non sono eligibili se le istruzioni sottostanti non sono regolate o se non è ancora giunta la data di pagamento dell'evento societario.
- Definitive Amount: indica l'importo del saldo definitivo idoneo al pagamento.

## 2.11.4 RP-MS40 SALDI COUPON COMPENSATION S.A. – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta l'elenco delle compensazioni, dovute ad interventi di rettifica delle Posizioni Contrattuali, per le quali è stato generato un saldo. Il report riporta l'importo del saldo (previsionale/definitivo) e gli importi delle compensazioni sottostanti il saldo.

Il report creato per l'Agente di Regolamento riporta in ciascuna pagina le informazioni relative ad un singolo Partecipante indicato in alto a sinistra.

Per una descrizione del contenuto del report, si prega di fare riferimento al report MS38.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS40

Dlv: GKK		Balances Coupon Compensation			RP-MS40	24 OCT'18	19:51:28	1	
Mor: AKK		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia							
Account : xxxxx									
Currency: USD USD - U.S. DOLLAR									
Causal : CA CORPORATE ACTION									
Mor	Isin	Tm	CVD Date	ASD Date	Provisional Amount	Definitive Amount	Total Amount		
AKK	US912828TS94	20170330BGJECJP1	31/03/2017	7/04/2017		468,75 D			
AKK	US912828TS94	20170330BGJECMP1	31/03/2017	10/04/2017		8.509,38 D			
AKK	US912828TS94	20170330BGJECOP1	31/03/2017	6/04/2017		2.093,75 D			
AKK	US912828TS94	20170330BGJECDP1	31/03/2017	5/04/2017		103,13 D			
AKK	US912828TS94	20170330BGJECOP1	31/03/2017	4/04/2017		1.343,75 D			
AKK	US912828TS94	20170330BGJEC4P1	31/03/2017	31/03/2017		468,75 D			
AKK	US912828TS94	20170330BGJEC7P1	31/03/2017	3/04/2017		518,75 D			
Totals					25.118,75 D	13.506,26 D	38.625,01 D		

## 2.11.5 RP-MS39 PAGAMENTI SALDI COUPON COMPENSATION – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta i pagamenti inviati tramite SWIFT MT202 relativi ai saldi definitivi di compensazioni dovuti a interventi di rettifica delle Posizioni Contrattuali.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS39

Mor: AKK		Payments Balances Coupon Compensation		RP-MS39	26 OCT 18	19:30:06	Page 1
		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
		Payment Date: 26/10/2018					
Account :	xxxxx						
Currency:	USD USD - U.S. DOLLAR						
Causal :	CA CORPORATE ACTION						
Mor	Isin	Trn	CVD Date	ASD Date	Definitive Amount	Total Amount	Payment Executed
ARK	XS0211034466	20131031AAAPT01	16/10/2018	31/10/2013	93,83 C		
ARK	XS0211034466	20131031AAAPSB01	16/10/2018	31/10/2013	93,83 D		
ARK	XS0211034466	20131101AABDYB01	16/10/2018	1/11/2013	35,41 D		
Totals					35,41 C	35,41 C	Y

- alla voce "currency" è indicata la valuta di regolamento della compensazione di contante (valuta di regolamento);
- alla voce "account" è riportato il conto del Partecipante (proprio/terzi);
- la voce "MBR" indica il Partecipante soggetto a Coupon Compensation
- la colonna "ISIN" indica l'ISIN dello strumento finanziario;
- la colonna "TRN" indica il TRN dell'istruzione;

A seconda di quale evento generi l'Istruzione di contante, il report riporta le seguenti informazioni

- CVD (Coupon Value Date): Data valuta del pagamento del coupon
- ASD (Actual Settlement Date): Data di regolamento effettiva dell'istruzione
- Definitive Amount: indica il saldo definitivo idoneo al pagamento. Il saldo è definitivo quando tutte le compensazioni sottostanti sono eligibili per il pagamento (Le compensazioni sono eligibili se le istruzioni sottostanti sono regolate e se è giunta la data di pagamento dell'evento societario.
- Payment Executed: Y/N . Indica se il messaggio MT202 è stato inviato per il regolamento.

## 2.11.6 RP-MS41 PAGAMENTI SALDI COUPON COMPENSATION S.A. – COMPARTO OBBLIGAZIONARIO ICSD

Il tabulato riporta le informazioni per gli Agenti di Regolamento relative ai i pagamenti inviati tramite SWIFT MT202 relativi ai saldi definitivi di compensazioni dovuti a interventi di rettifica delle Posizioni Contrattuali.

Il report riporta in ciascuna pagina le informazioni relative ad un singolo Partecipante indicato in alto a sinistra.

Per una descrizione del contenuto del report, si prega di fare riferimento al report MS39.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MS41

Dlvty: AKK		Payments Balances Coupon Compensation		RP-MS41	26 OCT 18	19:30:06	Page 1
Mor : GKK		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
		Payment Date: 26/10/2018					
Account :	xxxxx						
Currency:	EUR -EURO						
Causal :	CA CORPORATE ACTION						
<hr/>							
Mor	Isin	Tm	CVD Date	ASD Date	Definitive Amount	Total Amount	Payment Executed
ARK	XS0211034466	20131031AAAPT01	16/10/2018	31/10/2013	93,83 C		
ARK	XS0211034466	20131031AAAPSB01	16/10/2018	31/10/2013	93,83 D		
ARK	XS0211034466	20131101AABDYB01	16/10/2018	1/11/2013	35,41 D		
Totals					365,00 C	365,00 C	Y

## 2.12 Sezione XII: Estratti Conto Default Fund

### 2.12.1 RP-MDF1 ESTRATTO CONTO – DF EQUITY – BIT E DERIVATI

Il tabulato riporta le informazioni relative all'estratto conto per il Comparto Derivati Azionari e Azionario.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MDF1

D A T A		D A T A		VALUTA IN EURO	
MOV.TO	VALUTA	DESCRIZIONE CAUSALE	IMPORTO DARE	IMPORTO AVERE	
1/07/2014		RIPORTO	0,00	36.040.000,00	
4/07/2014	1/07/2014	INTERESSI ATTIVI	0,00	15.779,72	
4/07/2014	1/07/2014	MDF - SPESE INVIO ESTRAT. CONTO	2,50	0,00	
7/07/2014	7/07/2014	RESTITUIZ. CONT. IN ECCESSO	15.777,22	0,00	
9/07/2014	9/07/2014	SVIN. CONT. DIM. MARG. LIQUIDAT.	2.423.000,00	0,00	
6/08/2014	6/08/2014	SVIN. CONT. DIM. MARG. LIQUIDAT.	11.966.000,00	0,00	
3/09/2014	3/09/2014	MDF - VERSAMENTO MARGINE 90000	0,00	1.214.000,00	
SALDO CONTABILE			0,00	22.865.000,00	

CC&G Estratto Conto RP-MDF1 6 OCT 14 18:27:58 pag.1  
 DF Equity - BIT E DERIVATI  
 da data : 1/07/2014 a data : 30/09/2014  
 CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA S.p.A. 00000 BANCA xxxx  
 Via Nome, 00  
 0000 ROMA

DEFINITIVA

Imposta di bollo assolta in modo virtuale  
 Autorizzazione Agenzia delle Entrate  
 Direz. Provinciale I di Roma  
 Prot. n. 049801/2011 del 09/02/2011

- Il tabulato è prodotto con frequenza trimestrale, riportando i movimenti finanziari avvenuti nel periodo di riferimento;
- il tabulato viene prodotto per i soli Partecipanti Generali e Partecipanti Individuali ed è disponibile i primi giorni del mese successivo al trimestre di riferimento.

## 2.12.2 RP-MDF2 ESTRATTO CONTO SCALARE – DF EQUITY – BIT E DERIVATI

Il tabulato riporta le informazioni di dettaglio relative all'estratto conto scalare per il Comparto Derivati Azionari a Azionario.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MDF2

D A T A		SALDI PER VALUTA EURO		GIORNI	NR. DEBITORI	NR. CREDITORI
VALUTA	D A R E	A V E R E				
1/07/2014	0,00	36.055.777,22	1	0,00	36.055,77	
7/07/2014	0,00	36.040.000,00	1	0,00	36.040,00	
9/07/2014	0,00	33.617.000,00	1	0,00	33.617,00	
6/08/2014	0,00	21.651.000,00	1	0,00	21.651,00	
3/09/2014	0,00	22.865.000,00	1	0,00	22.865,00	
<b>SALDO CONTABILE</b>		0,00	150.228.777,22		0,00	150.228,77

  

D A T A		DECORRENZA	TASSO %	NUMERI	INTERESSI
1/07/2014	0,0260			36.055,77	26,04
8/07/2014	0,0270			36.040,00	27,03
9/07/2014	0,0330			33.617,00	30,82
7/08/2014	0,0140			21.651,00	8,42
17/09/2014	0,0930-			22.865,00	59,07-
<b>TOTALE LORDO</b>				150.228,77	33,24
<b>TOTALE INTERESSI NETTI</b>					33,24
<b>SPESE ESTRATTI CONTO</b>					2,50-
<b>COMPETENZE NETTE</b>					30,74

- il tabulato viene prodotto, con frequenza trimestrale, per i soli Partecipanti Generali e Partecipanti Individuali ed è disponibile i primi giorni del mese successivo al trimestre di riferimento;
- gli interessi maturati vengono liquidati/incassati trimestralmente;
- le colonne "**Saldi per valuta**" indicano per ciascun giorno l'ammontare totale del contante depositato.

### 2.12.3 RP-MMT1 ESTRATTO CONTO – DF BOND – OBBLIGAZION.MTS

Il tabulato riporta le informazioni relative all'estratto conto per il Comparto Obbligazionario.

#### ESEMPIO DI TABULATO RP-MMT1

CC&G		Estratto Conto		RP-MMT1	6 OCT 14	18:28:42	pag.1
		DF Bond	- OBBLIGAZION.MTS				
		CASSA DI	da data : 1/07/2014	a data : 30/09/2014			
		COMPENSAZIONE					
		E GARANZIA S.p.A.	00000 BANCA xxxx				
			Via Nome, 00				
			0000 ROMA				
DEFINITIVA							
				VALUTA IN EURO			
D A T A	D A T A	DESCRIZIONE CAUSALE					
MOV.TO	VALUTA		IMPORTO DARE	IMPORTO AVERE			
1/07/2014		RIFORTO	0,00	11.527.000,00			
4/07/2014	1/07/2014	INTERESSI ATTIVI	0,00	7.811,42			
4/07/2014	1/07/2014	SPESE INVIO ESTRATTO CONTO MMT	2,50	0,00			
7/07/2014	7/07/2014	RESTITUZ. CONT. IN ECCESSO	7.808,92	0,00			
8/07/2014	8/07/2014	VERS.MARGINI DF MTS SUL 90000	0,00	239.000,00			
10/07/2014	10/07/2014	VERS.MARGINI DF MTS SUL 90000	0,00	2.066.000,00			
24/07/2014	24/07/2014	SVIN.CONT.DIM. MARG. LIQUIDAT.	3.297.000,00	0,00			
6/08/2014	6/08/2014	SVIN.CONT.DIM. MARG. LIQUIDAT.	2.020.000,00	0,00			
4/09/2014	4/09/2014	SVIN.CONT.DIM. MARG. LIQUIDAT.	1.150.000,00	0,00			
SALDO CONTABILE			0,00	7.365.000,00			

Imposta di bollo assolta in modo virtuale  
 Autorizzazione Agenzia delle Entrate  
 Direz. Provinciale I di Roma  
 Prot. n. 049801/2011 del 09/02/2011

- Il tabulato è prodotto con frequenza trimestrale, riportando i movimenti finanziari avvenuti nel periodo di riferimento;
- il tabulato viene prodotto per i soli Partecipanti Generali e Partecipanti Individuali ed è disponibile i primi giorni del mese successivo al trimestre di riferimento.

## 2.12.4 RP-MMT2 ESTRATTO CONTO SCALARE – DF BOND OBBLIGAZION.MTS

Il tabulato riporta le informazioni di dettaglio relative all'estratto conto scalare per il Comparto Obbligazionario.

### ESEMPIO DI TABULATO RP-MMT2

D A T A		SALDI PER VALUTA EURO		GIORNI	NR. DEBITORI	NR. CREDITORI
VALUTA	D A R E	A V E R E				
1/07/2014	0,00	36.055.777,22	1	0,00	36.055,77	
7/07/2014	0,00	36.040.000,00	1	0,00	36.040,00	
9/07/2014	0,00	33.617.000,00	1	0,00	33.617,00	
6/08/2014	0,00	21.651.000,00	1	0,00	21.651,00	
3/09/2014	0,00	22.865.000,00	1	0,00	22.865,00	
SALDO CONTABILE		0,00	150.228.777,22		0,00	150.228,77

  

D A T A		NUMERI	INTERESSI
DECORRENZA	TASSO %		
1/07/2014	0,0260	36.055,77	26,04
8/07/2014	0,0270	36.040,00	27,03
9/07/2014	0,0330	33.617,00	30,82
7/08/2014	0,0140	21.651,00	8,42
17/09/2014	0,0930-	22.865,00	59,07-
TOTALE LORDO		150.228,77	33,24
TOTALE INTERESSI NETTI			33,24
SPESE ESTRATTI CONTO			2,50-
COMPETENZE NETTE			30,74

- il tabulato viene prodotto, con frequenza trimestrale, per i soli Partecipanti Generali e Partecipanti Individuali ed è disponibile i primi giorni del mese successivo al trimestre di riferimento;
- gli interessi maturati vengono liquidati/incassati trimestralmente;
- le colonne "**Saldi per valuta**" indicano per ciascun giorno l'ammontare totale del contante depositato.

## 3. Parte II Dati in Formato Elaborabile

Questa parte illustra i dati e i servizi che la *Euronext Clearing* rende disponibili in formato elaborabile ai Partecipanti e agli Agenti di Regolamento nonché i sistemi per il tramite dei quali sono resi disponibili: server SFTP, Sistema di Negoziazione del Mercato IDEM e Rete Nazionale Interbancaria

### 3.1 Sezione I: Server SFTP

Sul server SFTP di Euronext Clearing, [ccgsftp.icws.it](http://ccgsftp.icws.it), sono disponibili i dati Pubblici, utilizzabili dai Partecipanti per replicare la metodologia TIMS di calcolo dei Margini iniziali e i dati Privati ovvero del singolo partecipante.

#### 3.1.1 DATI PUBBLICI

I dati pubblici sono i files utilizzabili dai partecipanti per replicare la metodologia TIMS di calcolo dei Margini iniziali.

Per informazioni in merito ai campi ed al formato dei file si può far riferimento al documento Public Data Service disponibile sul sito.

Per lo scarico dei files pubblici dal server SFTP con procedure automatiche fare riferimento alle seguenti indicazioni:

**Directory contenente i files pubblici:** TIMSDATA

**Nomi dei files:**

YYMMDD.zip

YYMMDD: Data

#### 3.1.2 DATI PRIVATI

Sul server SFTP di Euronext Clearing, [ccgsftp.icws.it](http://ccgsftp.icws.it), sono disponibili i flussi elaborabili, utilizzabili dai Partecipanti per riconciliare automaticamente i dati calcolati con i propri sistemi di back office ed i dati prodotti da Euronext Clearing. In particolare sono disponibili le informazioni relative ai contratti negoziati, le posizioni contrattuali registrate, le garanzie depositate, le segnalazioni per il regolamento in liquidazione delle attività sottostanti i contratti registrati, la posizione finanziaria e le posizioni contrattuali in opzioni esercitate/assegnate nel corso della giornata di negoziazione. I flussi elaborabili sono di norma disponibili al termine dell'elaborazione batch notturna.

Per la descrizione dei tracciati record dei flussi elaborabili in questa sezione si rinvia al documento "Data Services", "Descrizione dei flussi elaborabili per il clearing member, disponibile sul sito web di Euronext Clearing" alla sezione Area tecnica/Documentazione/Manuali.

Per informazioni in merito ai campi ed al formato dei file si può far riferimento al documento Clearing Data Service disponibile sul sito.

Per lo scarico dei flussi elaborabili di clearing dal server SFTP con procedure automatiche fare riferimento alle seguenti indicazioni:

**Directory contenente i reports: FLUSSI**

**Nomi dei files:**

YYYYMMDD-XXXX-99999.txt

YYYYMMDD-XXXX-99999-99999.txt

YYYYMMDD: Data

XXXX: Nome del file (es. DS01)

99999: Codice Ente del Partecipante Diretto (es. 09000)

99999: Codice Ente del Cliente Negoziatore (es. 09001)

## **3.2 Sezione II: Sistema di Negoziazione IDEM**

Tramite il Sistema di Negoziazione del Mercato IDEM viene fornito il servizio di broadcasting dei contratti eseguiti per alimentare i propri sistemi di back office; Euronext Clearing inoltre rende disponibili ai Partecipanti i dati pubblici e privati i cui tracciati sono descritti nei seguenti paragrafi.

Per lo scarico dei dati di clearing per il tramite del sistema di Negoziazione Derivati IDEM consultare il manuale dell'IDEM disponibile sul sito della BIt Systems.

### **3.2.1 DATI PUBBLICI**

I dati pubblici sono utilizzabili dai Partecipanti per replicare la metodologia TIMS di calcolo dei Margini iniziali utilizzata dalla Euronext Clearing:

Per informazioni in merito ai campi ed al formato dei file si può far riferimento al documento Public Data Service disponibile sul sito.

### **3.2.2 DATI PRIVATI**

Per informazioni in merito ai campi ed al formato dei file si può far riferimento al documento Clearing Data Service disponibile sul sito.

### **3.3 Sezione III: Rendicontazione giornaliera dei pagamenti**

Tramite la Rete Nazionale Interbancaria (RNI) e la rete SWIFT Euronext Clearing mette a disposizione dei Partecipanti e dei loro Agenti di Regolamento:

- il messaggio M01, via RNI, contenente:
  - l'informativa sulla posizione finanziaria del Partecipante relativamente ai Default Funds;
  - l'informativa sulla richiesta di margini infragiornalieri.
- il messaggio M03, via RNI e il messaggio MT298, via SWIFT, contenenti il rendiconto giornaliero degli addebiti e degli accrediti che Euronext Clearing effettuerà sui conti PM dei Partecipanti Diretti o dei loro Agenti di Regolamento;

I dati riportati nei suddetti messaggi possono essere visualizzati nei sistemi informativi di proprietà e gestiti con procedure informatiche finalizzate all'automatizzazione dei processi interni.

La richiesta di attivazione della Rendicontazione Giornaliera può essere effettuata tramite collegamento al Member Portal (<https://memberportal.ccg.it/>).

### 3.3.1 MESSAGGIO M01

Il messaggio di rete interbancaria M01 contiene l'informativa sulla posizione finanziaria del Partecipante relativamente ai Default Funds e l'informativa sulla richiesta di versamento di margini infragiornalieri.

Tracciato Record Messaggio M01

Tipo messaggio: M01

Applicazione bancaria mittente: 90000CG011YY<sup>1</sup>

Applicazione bancaria destinataria: FFFFF<sup>2</sup>CG011YY<sup>1</sup>

Categoria applicativa: CG01

O/F	IDC	Campo	Formato
<b>Obbligatorio</b>	01	Tipo Messaggio	"3"b
<b>Obbligatorio</b>	040	Mittente	
<b>Obbligatorio</b>		▪ Codice Ente	"5"n
Facoltativo		▪ Codice Cab	/"5"n
Facoltativo		▪ Uff.	/"2"b
<b>Obbligatorio</b>	050	Destinatario	
<b>Obbligatorio</b>		▪ Codice Ente	"5"n
<b>Obbligatorio</b>		▪ Codice Cab	/"5"n
Facoltativo		▪ Uff.	/"2"b
Facoltativo		Data di riferimento	"8"n
<b>Obbligatorio</b>	61K	Orario di riferimento	"6"n
<b>Obbligatorio</b>	601	C.R.O	"11"n
<b>Obbligatorio</b>	020		
<b>Obbligatorio</b>	177	Codice Valuta	"3"b
<b>Obbligatorio</b>	054	Codice Ente Partecipante	"5"n
<b>Obbligatorio</b>	D31	Data operazione	"8"n
<b>Obbligatorio</b>	N01	Dettaglio delle operazioni (max. 41)	
		▪ Causale	"3"n
		▪ Importo	"15"n
		▪ Segno	"1"a
		▪ Data	"8"n

Descrizione Tracciato Record Messaggio M01

<sup>1</sup> YY = 00 (Produzione), YY = PR (Prova).

<sup>2</sup> FFFFF = Codice Ente.

**IDC 01 - TIPO MESSAGGIO**

Assume il valore "M01"

**IDC 040 – MITTENTE**

Contiene il codice Ente "90000" di Euronext Clearing. I codici CAB e UFF. non sono usati.

**IDC 050 – DESTINATARIO**

Operatore che riceve il messaggio (Ced Borsa o altro Ente): viene specificato il codice Ente del destinatario e, se necessario, i Cod. CAB e UFFICIO.

**IDC 61K – DATA DI RIFERIMENTO MESSAGGIO**

Data di invio messaggio in formato (ggmmaaaa).

**IDC 601 – ORARIO DI RIFERIMENTO**

Ora di invio messaggio in formato (hhmmss).

**IDC 020 – C.R.O**

Codice di riferimento dell'operazione assegnato al mittente.

**IDC 177 – CODICE DIVISA**

E' la divisa (EUR) in cui sono espressi gli importi presenti nel dettaglio operazioni e ne determina il numero di decimali.

**IDC 054 – CODICE ENTE PARTECIPANTE**

Riporta il codice Ente del partecipante al quale si riferisce il messaggio.

**IDC D31 – DATA OPERAZIONE**

E' la data di pagamento del margine.

**IDC N01 – DETTAGLIO OPERAZIONI**

Evidenzia il dettaglio della situazione del partecipante, costituita dalle seguenti informazioni:  
stringa operazione: EX: (N01:|101|000000500000000|D|00000000)

- A. N01: (4 caratteri) = identificativo riga messaggio
- B. Causale di riferimento (3 caratteri) (dettaglio causali riportato sotto)
- C. Importo (15 caratteri di cui due decimali)
- D. Segno dell'importo che può assumere due valori:  
(D) = per importo a debito del partecipante  
(C) = per importo a credito del partecipante
- E. Data di riferimento relativa alla causale

Dettaglio causali (N01) del messaggio M01

- 100 → 199: Non attivo
- 200 → 299: Non attivo
- 500 → 599: Non attivo
- 600 → 699: Default Fund

Causale	Descrizione sintetica
---------	-----------------------

#### MARGINI ATTUALI E RELATIVA COPERTURA

<b>X01</b>	Margine attuale
<b>X02</b>	Margine costituito in contante
<b>X03</b>	Contante in eccesso
<b>X04</b>	Fideiussione depositata
<b>X05</b>	Fideiussione utilizzata
<b>X06</b>	Fideiussione in eccesso

#### ADEGUAMENTO MENSILE DEI MARGINI

<b>X11</b>	Ammontare nuovo margine
<b>X12</b>	Margine da integrare il giorno di pagamento
<b>X13</b>	Margine da versare entro le ore 12 odierne
<b>X14</b>	Contante in eccesso in restituzione

#### CONTRIBUZIONI

<b>X21</b>	Non attiva
<b>X22</b>	Non attiva
<b>X23</b>	Non attiva

400 → 499: *Margini infragiornalieri*

Causale	Descrizione sintetica
---------	-----------------------

#### (MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI)

<b>413</b>	Richiesta Margini Aggiuntivi Infragiornalieri Conto Proprio
<b>414</b>	Richiesta Margini Aggiuntivi Infragiornalieri Conto Terzi

### *Legenda causali del messaggio M01*

Con il messaggio M01 il partecipante riceve tutti i giorni le casuali relative a:

“Margini attuali e relativa copertura”	(X01-X06),
“Adeguamento mensile dei margini”	(X11-X14),
“Quote, Commissioni e Interessi”	(X21-X24).

Di seguito vengono descritte nel dettaglio le singole causali. Per ciascuna causale è illustrato il codice, una descrizione sintetica e tra le parentesi la data di valorizzazione .

#### **Default Funds:**

- Causale x01: il margine attuale dovuto al Default Fund (tutti giorni);
- Causale x02: il margine costituito in contante rappresenta il margine coperto con versamento di contante (solo se esiste un deposito in contante);
- Causale x03: il contante in eccesso rappresenta l'ammontare in contante in eccesso rispetto a quello necessario per la copertura del margine dovuto
- Causale x04: la fideiussione depositata è pari alla fideiussione utilizzata (causale 105) più l'eventuale fideiussione in eccesso (causale 106) (solo in caso di deposito della fideiussione);
- Causale x11: l'ammontare nuovo margine indica il nuovo margine dovuto, calcolato sulla base dell'attività del partecipante nei due mesi precedenti (è presente tra il giorno di comunicazione dell'ammontare dei nuovi margini e quello di pagamento);
- Causale x12: il margine da integrare il giorno di pagamento indica l'ammontare del margine che deve essere versato entro le ore 9:30 del giorno di pagamento. Per i partecipanti che dispongono della funzione ICA, il giorno di pagamento è visualizzabile alla voce “Scadenza Pagamento”; per coloro che ricevono il messaggio M01 direttamente per il tramite della RNI, tale data è visualizzabile all'IDC D31 del messaggio tra il giorno di comunicazione dell'ammontare dei nuovi margini ed il giorno che precede quello di pagamento. E' presente qualora le garanzie già depositate ed utilizzabili non siano sufficienti a coprire la differenza tra gli ammontari di cui alle causali X11 e X01;
- Causale x13: il margine da versare entro le ore 9.30 odierne è il margine in contante che deve essere versato il giorno stesso entro il termine orario indicato (viene valorizzato il giorno di pagamento solo in caso di dovuto versamento del contante);
- Causale x14: il contante in eccesso in restituzione indica l'ammontare che viene restituito il giorno lavorativo bancario successivo a quello di pagamento, definito giorno di decorrenza o quello che, in altra data, si renda disponibile per il deposito di una fideiussione (il giorno in cui avviene l'effettiva restituzione del contante in eccesso);
- Causale x21: Debito per Commissione su fideiussione viene generato nel momento in cui viene inserita una fideiussione in procedura.
- Causale x22: Debito per Quota annua di partecipazione.
- Causale x24: Restituzione di contante per interessi.

**Margini infragiornalieri**

- Causale x13: Debito per Margini aggiuntivi infragiornalieri conto Proprio
- Causale x14: Debito per Margini aggiuntivi infragiornalieri conto Terzi

### 3.3.2 MESSAGGIO M03

Il messaggio M03 inoltrato tramite la Rete Nazionale Interbancaria, consente al Partecipante o al relativo Agente di Regolamento del contante di disporre delle informazioni relative agli addebiti e agli accrediti che saranno effettuati nella giornata sul proprio conto PM in Target2 da Euronext Clearing. Il contenuto e la rappresentazione dei flussi trasmessi sono strutturati, come di seguito riportato, secondo gli standard dei messaggi della Rete Nazionale Interbancaria.

#### Tracciato Record Messaggio M03

Applicazione bancaria mittente: 90000CG013YY

Applicazione bancaria destinatario: XXXXXCG013YY

Categoria applicativa: CG013

F/O	IDC	CAMPO	FORMATO
O	01	Tipo messaggio (M03)	"3"b
O	040	Mittente	"5"n(/"5"n/'2"b)
O	050	Destinatario	"5"n(/"5"n/'2"b)
O	020	CRO	"11"n
O	61K	Data di regolamento	"8"n
O	64H	Orario di riferimento	"6"n
F	N06	Dettaglio elemento (max 12)	
		▪ codice ENTE Partecipante	"5"n/
		▪ codice CAB Partecipante	"5"n/
		▪ Descrizione Partecipante	"40"b/
		▪ Importo	"15"n/
		▪ Segno	"1"b/
		▪ Codice Divisa	"3"b/
		▪ Mercato	"3"b/
		▪ Tipo Pagamento	"3"b/
		▪ Data Pagamento	"8"n/
		▪ Causale	"2"b/
		▪ Riferimento Operazione	"6"b/
		▪ Codice Conto Gestione	"5"n/
		▪ Tipo Conto	"1"b/
		▪ Campo Commento	"30"b

Applicazione bancaria mittente: 90000 indica il Codice Ente della Euronext Clearing; YY può assumere i seguenti valori:

00 = Ambiente di Produzione

PR = Ambiente di Prova

Applicazione bancaria destinatario: XXXXX indica il Codice ENTE del destinatario; YY può assumere i seguenti valori:

00 = Ambiente di Produzione

PR = Ambiente di Prova

## Descrizione Tracciato Record Messaggio M03

### IDC 01-TIPO MESSAGGIO

Assume il valore fisso M03.

### IDC 040-MITTENTE

Codice ENTE della Euronext Clearing (90000).

### IDC 050-DESTINATARIO

Codice ENTE del destinatario.

### IDC 020-C.R.O.

E' il codice di riferimento del messaggio inviato dalla Euronext Clearing. Gli ultimi due caratteri del codice rappresentano il CIN di controllo (modulo 13) dei primi nove.

### IDC 61K-DATA DI REGOLAMENTO

Data di invio della notifica (ggmmaaaa).

### IDC 64H-ORARIO DI RIFERIMENTO

Ora in cui viene creato il messaggio in formato HHMMSS.

### IDC N06

Dettaglio Elemento (MAX 12)

Codice Ente Partecipante: è il codice del Partecipante per il quale viene fatta la segnalazione

Codice CAB Partecipante: è il codice CAB del Partecipante per il quale viene fatta la segnalazione

Descrizione Partecipante: è la Denominazione del Codice Partecipante

Importo: è l'importo che il Partecipante deve pagare o ricevere

Segno: è il segno dell'importo, ed il valore può essere "D" (debito) o "C" (credito).

Codice Divisa: è la codifica alfanumerica della divisa (secondo standard ISO). Contiene il codice EURO.

Tipo versamento: MIF (per i pagamenti del Regolamento giornaliero dei margini) o BOR (per i pagamenti relativi ai Default Fund)

Tipo pagamento: può assumere i seguenti valori:

ADG = Regolamento giornaliero dei margini

MDF = Quota di contribuzione al Default Fund per i Comparti Azionario e Derivati Azionari

PET = Pagamenti delle penali di Settlement provenienti da T2S

PEI = Pagamenti delle penali di Settlement provenienti da ICSD

MMT = Quota di contribuzione al Default Fund per il Comparto Obbligazionario

Data Pagamento: è la data in cui deve essere effettuato il pagamento

Causale = può assumere i seguenti valori:

AV = se il pagamento è per una data valuta differita

PA = se il pagamento è per valuta odierna

Riferimento operazione: è un numero sequenziale nell'ambito dell'anno di elaborazione

Codice Conto di Gestione: 90000

Tipo Conto: per i pagamenti di tipo "MIF", può assumere i valori "P" (Proprio) o "T" (Terzi) per indicare il conto a cui è riferito il pagamento; non assume invece alcun valore quando il pagamento è di tipo "BOR".

Campo Commento: viene utilizzato per fare eventuali comunicazioni da parte di Euronext Clearing destinate ai Partecipanti.

### 3.3.3 MESSAGGIO MT298

Il messaggio MT298, inoltrato tramite la rete SWIFT, consente al Partecipante o al relativo Agente di Regolamento del contante di disporre delle informazioni relative agli addebiti e agli accrediti che saranno effettuati nella giornata sul proprio conto PM in Target2 da Euronext Clearing. Il contenuto e la rappresentazione dei flussi trasmessi sono strutturati secondo gli standard dei messaggi della rete SWIFT.

#### Tracciato Record Messaggio MT298

Corpo del messaggio:

{1:F01CCEGITRRA0010000000000}

{2:I298XXXXXXXXXXXXXXXXX}

{3:{108:0089430070190000}}

{4: :20:0089430070190000 :12:003

**:77E:CCG - Notice of N. 2 deb/cred payments on 2008-09-23**

**P01-L1**9999900000DENOMINAZIONE SOCIALE 000000007201875**DEUR**

**P01-L2**MIFADG20080923PA10222590000P/VARIE/MIF-ADG-99999-P-}

**P02-L1**9999900000DENOMINAZIONE SOCIALE 000000486507677**CEUR**

**P02-L2**MIFADG20080923PA10222590000T/VARIE/MIF-ADG-99999-T-}

#### Descrizione Tracciato Record Messaggio MT298

Le causali di pagamento sono indicate nel blocco 4 del TAG 77E, di cui si forniscono di seguito le necessarie informazioni:

- alla voce "**Notice of N...deb/cred payments on**" viene indicato il numero di pagamenti a debito/credito per la data specificata (formato AAAA-MM-GG);
- i numeri (**01**, **02**, ecc..) dopo la lettera "**P**" identificano il numero di pagamento a cui le informazioni successive si riferiscono;
- le informazioni relative a ciascun pagamento sono riportate su due righe distinte (**L1** e **L2**);
- la linea "**L1**" contiene, nell'ordine, le seguenti informazioni:
  - Codice Ente del Partecipante a cui si riferisce il pagamento (5 caratteri numerici);
  - CAB del Partecipante (5 caratteri numerici);
  - Denominazione Sociale del Partecipante (40 caratteri alfanumerici);
  - Importo (15 caratteri numerici: 13 interi e 2 decimali);

- Segno: **D** = Debito, **C** = Credito (1 carattere alfanumerico);
- Divisa (3 caratteri alfanumerici).
- la linea "**L2**" contiene, nell'ordine, le seguenti informazioni:
  - Tipo regolamento (3 caratteri alfanumerici). **MIF** = Regolamento giornaliero o infragiornaliero; **BOR** = Default Fund;
  - Tipo pagamento (3 caratteri alfanumerici). **ADG** = Regolamento giornaliero; **INF** = Margini aggiuntivi infragiornalieri; **MDF** = Default Fund per i Comparti Azionario e Derivati Azionari; **MMT** = Default Fund per il Comparto Obbligazionario; **IDF** = Interessi sui depositi effettuati per il Default Fund relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari; **IMT** = Interessi sui depositi effettuati per il Default Fund relativo al Comparto Obbligazionario;; **RES** = Restituzione Default Fund a seguito di recesso dal Sistema; **PET** = Pagamenti delle penali di Settlement con provenienza T2S; **PEI** = Pagamenti delle penali di Settlement con provenienza ICSD.
  - Data valuta (8 caratteri numerici; formato data: AAAAMMGG);
  - Valuta odierna o differita (2 caratteri alfanumerici). **PA** = valuta odierna; **AV** = valuta differita;
  - Numero progressivo del messaggio (6 caratteri numerici);
  - Conto PM di Euronext Clearing (5 caratteri numerici);
  - Conto a debito/credito (1 carattere alfanumerico). "**P**" = Conto Proprio, "**T**" = Conto Terzi;
  - Causale del pagamento (23 caratteri alfanumerici).

# 4. Parte III Infrastruttura Tecnologica

L'Infrastruttura Tecnologica per l'accesso al sistema di clearing si compone di due applicativi: BCS e ICWS.

## 4.1 Sezione I: BCS

La BCS consente di eseguire tutte le funzioni di trade allocation in tempo reale tra cui:

### Funzioni relative a tutti i Comparti

- Consultazione dei contratti eseguiti;
- Consultazione delle posizioni aperte;
- Consultazione delle garanzie in titoli e in contante depositate;
- Funzioni di Risk Management;
- Consultazione di Reports e Data Files.

### Funzioni relative ai Comparti Derivati

- Give-up internazionale;
- Give-up internazionale automatico;
- Trasferimento di contratti da T+1 a T+10;
- Trasferimento di posizioni;
- Separazione di contratti (splitting);
- Rettifica delle posizioni lorde in opzioni e futures;
- Esercizio delle opzioni anticipato e a scadenza;
- Modifica del codice open/close;
- Modifica del codice cliente;
- Allocazione delle azioni a garanzia delle posizioni in opzioni o futures;
- Apertura di sottoconti;
- Sospensione dei Clienti Negoziatori (Stop Button) da parte dei Partecipanti Generali.

## Orari di utilizzo

L'utilizzo della BCS è consentito dalle ore 7:45 alle ore 20:00, per le funzioni di consultazione e dalle ore 7:45 alle ore 18:30, per le funzioni dispositive.

La funzione di Sospensione dei Clienti Negoziatori (Stop Button) è sempre sospesa dalle ore 8:59 alle ore 9:01.

## Versioni

Si può optare per una diversa versione della BCS a seconda del/i Comparto/i a cui si aderisce e delle funzioni di cui si desidera usufruire. Per i Comparti Derivati la BCS è obbligatoria. Le versioni disponibili sono le seguenti:

- **BCS Standard:** prevede la diffusione dati in tempo reale e consente le funzioni di *trade allocation* come il trasferimento di posizioni, il trasferimento di contratti e il Give-up internazionale. Le funzioni abilitate per il Cliente Negoziatore sono le sole funzioni di esercizio anticipato, esercizio a scadenza, modifica del codice open/close e modifica del codice cliente;
- **BCS Plus:** oltre alle funzioni della *Standard*, consente il Give-up internazionale automatico. Il Cliente Negoziatore può averla soltanto se autorizzato dal proprio Partecipante Generale;
- **BCS Premium:** dedicata al solo Partecipante Generale, oltre alle funzioni della *Plus* consente l'accesso alle funzioni di *Risk Management*

con la possibilità di impostare delle soglie di allarme su posizioni e contratti. Include anche la funzione di sospensione del Cliente Negoziatore (c.d. *Stop Button*).

## Configurazioni

BCS è disponibile in tre differenti configurazioni a seconda della qualifica di partecipazione al Comparto:

- **BCS-GCM** per i Partecipanti Generali. Consente l'esecuzione delle funzioni anche per conto dei Clienti Negoziatori.
- **BCS-ICM** per i Partecipanti Individuali.
- **BCS-NCM** per i Clienti Negoziatori. Consente le funzioni autorizzate dal Partecipante Generale nel contratto accordo, compatibilmente con la versione BCS posseduta.

## Modalità di accesso

BCS è disponibile in due diverse modalità di accesso:

- BCS-WS: work station stand-alone grafica di tipo windows;
- BCS-API: Application Program Interface per automatizzare i processi end-to-end delle transazioni.

## Documentazione

La documentazione di BCS-WS e di BCS-API è disponibile sul sito internet di Borsa Italiana alla sezione "[Borsa Italiana – Servizi di Trading – BCS](#)".

## Connettività e protocollo di comunicazione

BCS è integrata con la rete del mercato e pertanto i Partecipanti negoziatori potranno utilizzare le linee già operative per l'accesso al mercato, scegliendo il protocollo di comunicazione di tipo HTTPS o VPN client. I Partecipanti che svolgono il ruolo di Clearer Puro dovranno invece attivare la connessione su linea dedicata con protocollo di comunicazione di tipo HTTPS o VPN client o su Internet con protocollo di comunicazione di tipo HTTPS, VPN Client o VPN tunnel IP sec.

## 4.2 Sezione II: ICWS

**ICWS** consente di eseguire le seguenti funzioni:

- Consultazione di Reports e Data Files;
- Consultazione dei dati contabili relativi ai Default Fund.

### Orari di utilizzo

L'utilizzo della ICWS è consentito dalle ore 7:45 alle ore 20:00.

### Versioni

E' prevista una sola versione ICWS per tutti i Comparti.

### Configurazioni

E' prevista una sola configurazione ICWS per tutte le qualifiche di adesione (GCM, ICM e NCM).

ICWS viene fornita in una sola configurazione. I Partecipanti Diretti di tutti i Comparti devono dotarsi di ICWS. Anche i Clienti Negoziatori possono dotarsi di ICWS, **ma per le sole funzioni di gestione della reportistica**, se autorizzati dal Partecipante Generale.

### Connettività e protocollo di comunicazione

ICWS è disponibile su rete internet con protocollo di comunicazione HTTPS con certificato digitale.

## 4.3 Sezione III: Dotazione tecnologica per Partecipante e Comparto

Si indica di seguito, per ciascuna tipologia di Partecipante, la dotazione tecnologica richiesta da Euronext Clearing per l'adesione ai diversi Comparti del Sistema.

### Partecipante Generale

#### Comparti Derivati:

- BCS-GCM: BCS-WS (due user) + BCS-API opzionale (due user);
- ICWS (due user).

#### Comparti Cash:

- BCS-GCM (opzionale): BCS-WS (due user) + BCS-API (due user);
- ICWS (due user).

### Partecipante Individuale

#### Comparti Derivati:

- BCS-ICM: BCS-WS (due user) + BCS-API opzionale (due user);
- ICWS (due user).

#### Comparti Cash:

- BCS-ICM (opzionale): BCS-WS (due user) + BCS-API (due user);
- ICWS (due user).

### Cliente Negoziatore

#### Comparti Derivati:

- BCS-NCM: BCS-WS (due user) + BCS-API opzionale (due user);
- ICWS (opzionale), solo con autorizzazione del Partecipante Generale (due user).

#### Comparti Cash:

- BCS-NCM (opzionale): BCS-WS (due user) + API (due user);
- ICWS (opzionale), solo con autorizzazione del Partecipante Generale (due user).

# Contatti

## Operations

[ccp-operations@euronext.com](mailto:ccp-operations@euronext.com)

+39 06 32395 321

+39 06 32395 303

---

Questa pubblicazione è fornita unicamente a titolo informativo e non costituisce una raccomandazione d'investimento. Questa pubblicazione viene fornita nello stato in cui si trova ("as is") senza rappresentazioni o garanzie di alcun tipo. Pur avendo utilizzato tutta l'attenzione necessaria al fine di assicurare l'esattezza del contenuto, Euronext non ne garantisce l'accuratezza, né la completezza. Euronext non può essere ritenuta responsabile per eventuali perdite o danni di qualsiasi natura derivanti dall'utilizzo diretto o indiretto delle informazioni contenute in questa pubblicazione, dalla fiducia accordata al suo contenuto o da condotte fondate sulla medesima. Nessuna informazione contenuta o a cui si fa riferimento in questa pubblicazione può essere considerata come costitutiva di diritti o obblighi a carico di Euronext o potrà costituire il fondamento di un contratto. La costituzione di diritti e di obblighi relativi a strumenti finanziari negoziati sui mercati organizzati dalle società del gruppo Euronext deriva esclusivamente dalle regole del gestore del mercato interessato. Tutti i diritti di proprietà e gli interessi relativi o connessi a questa pubblicazione sono di proprietà esclusiva di Euronext. Nessuna parte di questa pubblicazione potrà essere ridistribuita o riprodotta senza il previo consenso scritto di Euronext.

Euronext indica Euronext N.V. e le sue consociate. Per qualsiasi informazione relativa ai marchi e ai diritti di proprietà intellettuale di Euronext, si prega di consultare il seguente sito Internet [euronext.com/terms-use](https://euronext.com/terms-use)

© 2024, Euronext N.V. – Tutti i diritti riservati.



[euronext.com/post-trade/euronext-clearing](https://euronext.com/post-trade/euronext-clearing)