MANUALE TECNICO

Versione 2.0

APRILE 2021

CC&G

A EURONEXT COMPANY

INDICE

1. PREMESSA 9

2. PARTE I TABULATI DI CLEARING 11

2.1 Sezione I: Operazioni 12

2.1.1 RP-MT12 Contratti Conclusi Opzioni 12

2.1.2 RP-MT05 Posizioni nette per Contratti in Opzioni 13

2.1.3 RP-MT02 Opzioni Esercitate e/o Assegnate 15

2.1.4 RP-MT04 Trasferimenti non completati 17

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-MT63 Contratti Conclusi Futures IDEX 21

2.1.9 RP-MTG2 Contratti Conclusi Futures AGREX 22

2.1.10 RP-MT55 Posizioni Nette per Contratti Futures IDEM 24

2.1.11 RP-MTE5 Posizioni nette per Contratti Futures IDEX 26

2.1.12 RP-MTG5 Posizioni nette per Contratti Futures AGREX 28

2.1.13 RP-MT64 Futures Trasferiti in Give-Up 30

2.1.14 RP-MT65 Futures Ricevuti in Give-Up 31

2.1.15 RP-MT06 Contratti trasferiti mediante BCS 32

2.1.16 RP-MC03 Consegne Alternative prima fase 34

2.2 Sezione II: Posizioni Contrattuali 37

2.2.1 RP-MP01 Posizioni Aperte Opzioni nei conti 37

2.2.2 RP-MP02 Posizioni Aperte Opzioni nei sottoconti 38

2.2.3 RP-MS59 Operazioni sul capitale: posizioni in Opzioni rettificate 40

2.2.4 RP-MP11 Opzioni Scadute 41

2.2.5 RP-MP51 Posizioni Aperte Futures IDEM nei conti 42

2.2.6 RP-MP52 Posizioni Aperte Futures IDEM nei sottoconti 43

2.2.7 RP-MPE1 Posizioni Aperte Futures IDEX 45

2.2.8 RP-MPG1 Posizioni Aperte Futures AGREX nei conti 46

2.2.9 RP-MPG2 Posizioni Aperte Futures AGREX nei sottoconti 47

2.2.10 RP-MPE2 Posizioni Aperte Futures IDEX Pre-Cascading 48

2.2.11 RP-MPE3 Posizioni Futures IDEX - Cascading 49

2.2.12 RP-MX11 Posizioni Futures IDEX Post-Shifting 50

2.2.13 RP-MP31 Posizioni aperte obbligazioni 51
2.2.14 RP-MP21 Posizioni aperte azioni 52
2.2.15 RP-MC01 Abbinamenti posizioni AGREX in consegna/ritiro 53
2.2.16 RP-MC02 Posizioni AGREX in consegna regolate e da regolare 55
2.2.17 RP-MC06 Posizioni in vendita AGREX.....57
2.2.18 RP-MC07 Posizioni in vendita non coperte AGREX 59
2.2.19 RP-MC08 Contratti Futures AGREX regolati nel giorno 61
2.3 Sezione III: Garanzie 63
2.3.1 RP-MA01 Garanzie Collaterali Costituite 63
2.3.2 RP-MA03 Controvalore Garanzie Collaterali.....65
2.3.3 RP-MI01 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri 68
2.3.4 RP-MI02 Controvalore Garanzie Collaterali infragiornaliere 69
2.4 Sezione IV: Regolamento Margini e Default Fund 72
2.4.1 RP-MS52 Avviso di Addebito/Accredito 73
2.4.2 RP-MS53 Pagamenti giornalieri per il Partecipante Diretto 75
2.4.3 RP-MS01 Sintesi Giornaliera 77
2.4.4 RP-MS11 Posizione Finanziaria 79
2.4.5 RP-MS12 Dettaglio Posizione Finanziaria 82
2.4.6 RP-MS22 Margini Iniziali Comparti Azionario e Derivati Azionari 83
2.4.7 RP-MS24 Marginazione separata Sottoconti Comparti Azionario e Derivati Azionari.....84
2.4.8 RP-MS42 Margini Iniziali calcolati separatamente per Comparto 85
2.4.9 RP-MSE2 Margini Iniziali Comparto Derivati dell'Energia 87
2.4.10 RP-MSE4 Margini Iniziali posizioni Futures IDEX in consegna 88
2.4.11 RP-MSE6 Marginazione separata Sottoconti IDEX – posizioni ordinarie .89
2.4.12 RP-MSE8 Marginazione separata Sottoconti IDEX – posizioni in consegna 90
2.4.13 RP-MS61 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – posizioni marginabili 91
2.4.14 RP-MS62 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario - Mark-to-Market...92
2.4.15 RP-MS63 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – attribuzione classi93
2.4.16 RP-MS64 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – abbattimento intra-classe 94
2.4.17 RP-MS65 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – abbattimento inter-classi 95
2.4.18 RP-MS67 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario – margine finale....96

2.4.19 RP-MS70 Margini Iniziali Comparto Obbligazionario ICSD 97
2.4.20 RP-MS00 Riepilogo Margini Iniziali 98
2.4.21 RP-MI00 Riepilogo Margini Intraday 99
2.4.22 RP-MS33 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri 100
2.4.23 RP-MS31 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri 101
2.4.24 RP-MS32 Margini Aggiuntivi Infragiornalieri 102
2.4.25 RP-MS35 Avviso di Addebito Margini Intraday 103
2.4.26 RP-MS36 Intraday - Importi GCM/NCM 105
2.4.27 RP-MC09 Cash Settlement per inadempimento AGREX 107
2.4.28 RP-MSG1 Margini Iniziali su posizioni in consegna abbinate 109
2.4.29 RP-MSG2 Margini Iniziali Ordinari AGREX 110
2.4.30 RP-MSG4 Margini Iniziali su Consegna e Maggiorati AGREX 111
2.4.31 RP-MS14 Default Fund: sintesi mensile 112
2.4.32 RP-MS15 Default Fund: dettaglio calcolo 113
2.4.33 RP-MMDF Variazione Default Fund Comparti Azionario e Derivati Azionari 114
2.4.34 RP-MMMT Variazione Default Fund Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 115
2.4.35 RP-MMEL Variazione Default Fund Comparto Derivati dell'Energia 116
2.4.36 RP-MMAG Variazione Default Fund Comparto Derivati su Commodities Agricole 117
2.5 Sezione V: Interessi e Commissioni 118
2.5.1 RP-MS05 Interessi Mensili Maturati 118
2.5.2 RP-MF40 Commissioni giornaliere di rettifica 119
2.5.3 RP-MT36 Riepilogo Servizi Addebitati 121
2.5.4 RP-MT37 Elenco dei Servizi Sottoscritti 123
2.5.5 RP-MT48 Commissioni Mensili accumulate 124
2.5.6 RP-MT47 Commissioni Fail accumulate 126
2.5.7 RP-MFM4 Commissioni Obbligazionario Retail 127
2.5.8 RP-MFM6 Commissioni Obbligazionario Wholesale 128
2.5.9 RP-MFM8 ICSD - Retail Commissioni Mensili 129
2.5.10 RP-MFM9 ICSD - Commissioni Giornaliere 131
2.6 Sezione VI: Scadenza Opzioni 132
2.6.1 RP-MX01 Opzioni in scadenza 132
2.6.2 RP-MX04 Opzioni su Azioni Assegnate a Scadenza 134

2.7 Sezione VII: Liquidazione Sottostanti dei Derivati 135

2.7.1 RP-MD01 Opzioni Esercitate/Assegnate da liquidare..... 135

2.7.2 RP-MD51 Posizioni Futures in Consegna/Ritiro 136

2.7.3 RP-MD55 Titoli e controvalori in liquidazione sottostanti dei derivati azionari 137

2.8 Sezione VIII: Fail, Buy-In e Sell-Out..... 138

2.8.1 RP-ME30 Posizioni in fail marginabili - Comparti Azionario e Derivati Azionari..... 138

2.8.2 RP-ME31 Posizioni in fail marginabili - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 140

2.8.3 RP-MP10 Posizioni fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari 142

2.8.4 RP-MP13 Posizioni fail - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 143

2.8.5 RP-MP14 Posizioni in fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari 144

2.8.6 RP-MP15 Posizioni fail - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 145

2.8.7 RP-MS27 Margini Posizioni Fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari 146

2.8.8 RP-MS97 Margini Posizioni Fail - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 147

2.8.9 RP-MS90 Margini Iniziali Fail Comparto Obbligazionario ICSD..... 148

2.8.10 RP-MS91 Contratti selezionati 149

2.8.11 RP-MS92 Calculation of Initial Margins 150

2.8.12 RP-MS93 Calcolo dei margini Fail..... 151

2.8.13 RP-ME01 Buy-in Notice - Comparti Azionario e Derivati Azionari 152

2.8.14 RP-ME02 Buy-in Notice - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 153

2.8.15 RP-ME03 Sell-Out Notice - Comparti Azionario e Derivati Azionari..... 154

2.8.16 RP-ME04 Sell-Out Notice - Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 155

2.8.17 RP-ME05 Notifica di esecuzione di Buy-in - Comparti Azionario e Derivati Azionari..... 157

2.8.18 RP-ME06 Notifica di esecuzione di Buy-in - Comparto Obbligazionario 160

2.8.19 RP-ME07 Notifica di esecuzione di Sell-Out - Comparti Azionario e Derivati Azionari..... 161

2.8.20 RP-ME08 Notifica di esecuzione di Sell-Out – Comparto Obbligazionario162

2.8.21 RP-ME09 Esito Buy-In/partecipante in fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari..... 163

2.8.22 RP-ME10 Esito Buy-In/partecipante in bonis - Comparti Azionario e Derivati Azionari 165

2.8.23 RP-ME11 Esito Buy-In/partecipante in fail - Comparto Obbligazionario 167

2.8.24 RP-ME12 Esito Buy-In/partecipante in bonis- Comparto Obbligazionario 168

2.8.25 RP-ME13 Cash settlement/partecipante in fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari 169

2.8.26 RP-ME14 Cash settlement/partecipante in bonis - Comparti Azionario e Derivati Azionari 171

2.8.27 RP-ME15 Cash settlement /partecipante in fail - Comparto Obbligazionario 173

2.8.28 RP-ME16 Cash settlement /partecipante in bonis - Comparto Obbligazionario 174

2.8.29 RP-ME17 Esito Sell-Out - Comparto Azionario e Derivati Azionari 175

2.8.30 RP-ME18 Esito Sell-Out - Comparto Obbligazionario 177

2.8.31 RP-ME20 Compensazione dei fails in esecuzione di Buy-In Comparti Azionario e Derivati Azionari 178

2.8.32 RP-ME21 Compensazione dei fails in esecuzione di Buy-In – Comparto Obbligazionario 180

2.8.33 RP-ME25 Esecuzione Buy-In/Parzializzazione – Comparto Azionaro e Derivati Azionari 181

2.8.34 RP-ME26 Esecuzione Buy-In/Parzializzazione - Comparto Obbligazionario 183

2.8.35 RP-ME40 Proroga Data Fine Validità Partecipante Diretto/Comparti Azionario e Derivati Azionari 184

2.8.36 RP-ME41 Proroga Data Fine Validità Partecipante Diretto/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 185

2.8.37 RP-ME42 Proroga Data Fine Validità Partecipante Generale/Comparti Azionario e Derivati Azionari 186

2.8.38 RP-ME43 Proroga Data Fine Validità Partecipante Generale/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 187

2.8.39 RP-ME44 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Diretto/Comparti Azionario e Derivati Azionari 188

2.8.40 RP-ME45 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Diretto/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 189

2.8.41 RP-ME46 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Generale/Comparti Azionario e Derivati Azionari 191

2.8.42 RP-ME47 Istruzioni in Esecuzione di Buy In Partecipante Generale/Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD 192

2.8.43 RP-MD21 Parzializzazione e Splitting - Comparto obbligazionario ICSD 193
2.8.44 RP-MD22 parzializzazione - Comparto obbligazionario ICSD per Agente di Regolamento 195
2.9 Sezione IX: Sottoconti 196
2.9.1 RP-MC05 Sottoconti AGREX 196
2.10 Sezione X: Basilea III – Asset Class 197
2.10.1 RP-MB01 AGREX asset class 197
2.10.2 RP-MB02 Equity Derivates asset class 198
2.10.3 RP-MB03 IDEX asset class 199
2.10.4 RP-MB04 BOND asset class 200
2.11 Sezione XI: Corporate Actions 201
2.11.1 RP-MS18 Istruzioni di Contante – Comparto Obbligazionario ICSD 201
2.11.2 RP-MS21 Istruzioni di Contante S.A. – Comparto Obbligazionario ICSD 203
2.11.3 RP-MS38 Saldi Coupon Compensation – Comparto Obbligazionario ICSD 204
2.11.4 RP-MS40 Saldi Coupon Compensation S.A. – Comparto Obbligazionario ICSD 205
2.11.5 RP-MS39 Pagamenti Saldi Coupon Compensation – Comparto Obbligazionario ICSD 206
2.11.6 RP-MS41 Pagamenti Saldi Coupon Compensation S.A. – Comparto Obbligazionario ICSD 207
2.12 Sezione XII: Estratti Conto Default Fund 208
2.12.1 RP-MAG1 Estratto Conto – DF Agrex - Commodit. Agricole 208
2.12.2 RP-MAG2 Estratto Conto Scalare – DF Agrex - Commodit. Agricole 209
2.12.3 RP-MDF1 Estratto Conto – DF Equity - Bit e Derivati 210
2.12.4 RP-MDF2 Estratto Conto Scalare – DF Equity - Bit e Derivati 211
2.12.5 RP-MEL1 Estratto Conto – DF Idex - Mercato Elettrico 212
2.12.6 RP-MEL2 Estratto Conto Scalare – DF Idex - Mercato Elettrico 213
2.12.7 RP-MMT1 Estratto Conto – DF Bond - Obbligazion.MTS 214
2.12.8 RP-MMT2 Estratto Conto Scalare – DF Bond - Obbligazion.MTS 215
3. PARTE II DATI IN FORMATO ELABORABILE 216
3.1 Sezione I: Server FTP 216
3.1.1 Dati Pubblici 216
3.1.2 Dati Privati 216
3.2 Sezione II: Sistema di Negoziazione IDEM 218
3.2.1 Dati Pubblici 218

3.2.2 Dati Privati 218
3.3 Sezione III: Rendicontazione giornaliera dei pagamenti 219
3.3.1 Messaggio M01 220
3.3.2 Messaggio M03 224
3.3.3 Messaggio MT298 227
4. PARTE III INFRASTRUTTURA TECNOLOGICA 229
4.1 Sezione I: BCS 229
4.2 Sezione II: ICWS 231
4.3 Sezione III: Dotazione tecnologica per Partecipante e Comparto 232

1. PREMESSA

Con il presente Manuale Tecnico si illustrano le informazioni ed i servizi che la *CC&G* 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:

PARTE I: TABULATI DI CLEARING

Descrive i tabulati di *clearing* (definiti *Reports* nelle Istruzioni) che la *CC&G* 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 CC&G 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 – Sottoconti: Report dei Sottoconti per l'AGREX;

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.

PARTE II: DATI IN FORMATO ELABORABILE

Illustra i dati e i servizi che CC&G 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 FTP

Sezione II – Sistema di Negoziazione IDEM

Sezione III – Rendicontazione giornaliera dei pagamenti

PARTE III: INFRASTRUTTURA TECNOLOGICA

Illustra l'Infrastruttura Tecnologica di CC&G 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 FTP (**ftp.ccg.it**), il cui accesso in entrambi i casi è consentito sottoscrivendo la Richiesta Servizi tramite il Member Portal (**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 CC&G alla sezione **Operations>Manuali**.

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

Directory contenete 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 Consegna	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento
Conto: TERZI *OMN							
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 a CC&G. 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 CC&G 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
                   Precedente  Posiz. Aperte            Acquisti  Prezzo      Prezzo di   Margine di         Num.
Serie              Attivita'   Corte  Lunghe  Mkt  O/C  Vendite   Prec/Contr  Chiusura    Variazione/Premio  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 evidenziati 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 evidenziati 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 CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Contrattazioni Del: 19 JAN 01

Serie	Conto	Esercitate	Assegnate	Valore Di Esercizio Debito	Valore Di Esercizio Credito	Data di Liquid.	Prezzo di Liquid.	Tipo di Liquid.
BTP JN01 102 C	T *OMN	10		0		22 Jan 01	102,88	FUT
BIP JA01 7,20 C	T *OMN		3	,00	21.600,00	24 JAN 01	7,20	ST
ENI JA01 7,20 P	T *OMN		10	72.000,00	,00	24 JAN 01	7,20	ST
OIB30 JA01 45000 C	T *OMN		7	3.780,00	,00	22 JAN 01	45216	CSH
OL JA01 3 P	T *OMN		1	15.000,00	,00	24 JAN 01	3	ST
OL JA01 3,40 P	T *OMN		3	51.000,00	,00	24 JAN 01	3,40	ST
SPG JA01 2 C	T *OMN	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 CC&G*;*

- ◊ 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 CC&G 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 per la mancata accettazione da parte della controparte entro i termini previsti. Le proposte di trasferimento non accettate dalla controparte sono automaticamente cancellate a fine giornata.

Esempio di Tabulato RP-MT04

```
Ader: XXXX/XXXXXXXXX      Trasferimenti non completati    RP-MT04      4 FEB 14  21:36:04   Pag. 1
                            CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
                                  Data richiesta: 4 FEB 14

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     054285  03/02/14 ,1250      250  H 0000  O  TIT4L0.80   21782 F80LDN     F80LDN
 D   C 09:16  N     054406  03/02/14 ,1250        5  H 0000  O  TIT4L0.80   21782 F80LDN     F80LDN
 D   C 09:17  N     054285  03/02/14 ,1250      250  H 0000  O  TIT4L0.80   21782 F80LDN     F80LDN
 D   C 09:17  N     054406  03/02/14 ,1250        5  H 0000  O  TIT4L0.80   21782 F80LDN     F80LDN
```

◊ 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;

◊ La colonna "**Data**" indica la data del contratto non trasferito;

◊ la colonna "**Prezzo**" indica il prezzo del contratto non trasferito;

◊ La colonna "**Sts**" indica se la proposta di trasferimento è stata ignorata (H), cancellata dallo stesso Partecipante che l'ha inviata (C) o rifiutata dalla controparte ricevente (R);

◊ 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                                 Acquisto/   Contratti     Partecipante                          Numero di
        Consegna                     Prezzo      Vendita    Negoziati     di Clearing                             Riferimento
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
SPMIB 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 Consegna				Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento
Conto : TERZI				*OMN						
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	YYXX	40,00	104962
		MAR01	6,40	P	0,1785	V	400	YYXX	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	VVRR	,41	114228
		JAN01	45500	C	34	A	1	VVRR	,41	114232
		JAN01	45500	C	34	A	1	VVRR	,41	114291
		JAN01	45500	C	35	A	2	VVRR	,82	114322
		JAN01	45500	C	30	A	10	VVRR	4,10	114454
		JAN01	45500	C	33	A	100	VVRR	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 CC&G. 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 Consegna	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento
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-MT63 Contratti Conclusi Futures IDEX

Il tabulato elenca i contratti futures negoziati sul Mercato IDEX dal Partecipante o ricevuti in give-up.

Esempio di Tabulato RP-MT63

```
Ader:   GKK          Contratti Conclusi FUTURES IDEX      RP-MT63 4 SEP 08 14:44:26 Pag.1
                            CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Valuta: EURO         Contrattazioni Del:  28 JAN 08

              Contratti conclusi dall'aderente nella giornata :

Contratto  Mese                 Acquisto/  Contratti  Eseguiti    Commissioni    Numero di
           Consegna    Prezzo   Vendita    Negoziati  Partecipan  di Clearing    Riferimento

Conto : TERZI   *OMN

M02FB F    MAR08       68,00    A            150                    1,50         100002
Q01FB F    JUN08       66,00    V            200                    2,00         100003
                                               Totale Sotto Conto   3,50
                                               Totale Conto         3,50
Conto : PROPRIO *OMN

M01FB F    FEB08       41,20    A            100                    1,00         100001
Y01FB F    DEC09       44,00    A            250                    2,50         100004
                                               Totale Sotto Conto   3,50
                                               Totale Conto         3,50
```

- ◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati sull'Energia 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.

2.1.9 RP-MTG2 Contratti Conclusi Futures AGREX

Il tabulato elenca i contratti Futures negoziati sul Mercato AGREX dal Partecipante o ricevuti in Give-up nella giornata di riferimento.

Esempio di Tabulato RP-MTG2

```
Ader.: BAN1 BANCA UNO SPA          Contratti Conclusi Futures AGREX          RP-MTG2    21 AUG 12   19:47:53 Pag.    1
                                   COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Valuta:   EUR - EURO               Contrattazioni Del:  21 AUG 12
                                 Contratti conclusi dall'aderente nella giornata :

Contratto Mese                          Acquisto/  Contratti      Eseguiti          Commissioni      Numero di
          Consegna              Prezzo  Vendita   Negoziati       Aderente          di Clearing      Riferimento

Conto : TERZI  *OMN
DWHEAT F DWHEAT2H               101,03      V          4           BAN2                   40,00        900002
         DWHEAT2I               101,25      V          5           BAN5                   50,00        900004

                                                            Totale Sotto Conto          90,00
                                                                 Totale Conto           90,00
Conto : PROPRIO *OMN
DWHEAT F DWHEAT2H               101,03      A          3                                  30,00        900009
         DWHEAT2I               101,25      A          7                                  70,00        900012

                                                            Totale Sotto Conto         100,00
                                                                 Totale Conto          100,00
```

- ◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce;
- ◊ La colonna "**Mese Consegna**" riporta il simbolo della serie Futures negoziata.
- ◊ Alla riga "**Conto**" viene indicato il Conto (Proprio o Terzi) e l'eventuale sottoconto per il quale il contratto è stato negoziato.
- ◊ La colonna "**Prezzo**" riporta il prezzo di negoziazione del contratto.
- ◊ La colonna "**Acquisto/Vendita**" assume il valore "**A**" in caso di acquisto o "**V**" in caso di vendita.
- ◊ La colonna "**Contratti Negoziati**" indica il numero di lotti negoziati con il contratto.
- ◊ Per i contratti ricevuti in Give-Up, la colonna "**Eseguiti Aderente**" indica il codice alfabetico del Partecipante negoziatore.

- La colonna "**Commissioni di Clearing**" indica le commissioni di clearing che saranno applicate al contratto eseguito.

- La colonna "**Numero di Riferimento**" indica il numero di riferimento del contratto.

2.1.10 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 *OMN                            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
SPMIB SP05           29JUN05      27                              32341      32420                     10.665,00 DR
SPMIB SP05                         2+        I   O        S      32325      32595                      2.700,00 DR     109034
SPMIB SP05                              2+ I   O        B      32615      32595                        200,00 DR     109812
SPMIB SP05           TRANSFER      3-        I                   32420      32595                      2.625,00 CR
SPMIB SP05           TRF TRD             1+ I                   32330      32595                      1.325,00 CR     109934
SPMIB SP05           TRF POS       1+        I                   32420      32595                        875,00 DR

  POSIZIONE NETTA ATTAULE          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 evidenziati 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 evidenziati nei reports: MT14, MT15, MT64, MT65 e MT06.

◊ eventuali segnalazioni "**POS CHG**" sono da intendersi come interventi di CC&G 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.

2.1.11 RP-MTE5 Posizioni nette per Contratti Futures IDEX

Il tabulato indica l'importo da regolare con la *CC&G* a titolo di margini di variazione giornalieri a fronte dell'attività in futures sull'Energia.

Esempio di Tabulato RP-MTE5

```
Ader: GKK                                  Posizioni Nette Per Contratto FUTURES IDEX     RP-MTE5    22 DEC 07  21:03:09 Pag. 1

                                                 CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Conto:PROPRIO *OMN                                Contrattazioni del: 21 DEC 07


                   Precedente Posiz. Aperte            Acquisti    Prezzo  Prezzo di                    Margine        Num.
Serie              Attivita'  Corte  Lunghe Mkt O/C    Vendite Prec/Contr  Chiusura                di Variazione        di Rif


M01FB  JA08          20DEC07    320                                60,88      61,88                  238.080,00 DR
M01FB  JA08          TRANSFER     3-                               60,88      61,88                    2.232,00 CR
M01FB  JA08          TRF POS            1+                         60,88      61,88                      744,00 DR

  POSIZIONE NETTA ATTUALE        216                                                                  236.592,00 DR


Q02FB  JN08                           201+     O          A        62,25      62,54                  127.305,36 CR    109098
Q02FB  JN08          TRF TRD            1-                         62,25      62,54                      633,36 DR    109098

  POSIZIONE NETTA ATTUALE              200                                                            126.672,00 CR


Y01FB  DC09          20DEC07    105                                54,20      53,90                  275.940,00 CR

  POSIZIONE NETTA ATTUALE        105                                                                  275.940,00 CR



                                                     Totale Margini di Variazione   EU               166.020,00 CR
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati dell'Energia ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;

◊ le posizioni contrattuali trasferite vengono evidenziate con la dizione: "**TRANSFER**", se relative a trasferimento manuale effettuato per il tramite dell'inoltro dei moduli dispositivi da parte dei Partecipanti a CC&G; "**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 evidenziati con la dizione: "**TRF TRD**". Tali trasferimenti sono altresì riportati nel report MT06 contenente la lista di tutti i contratti trasferiti mediante BCS, compresi quelli effettuati in regime di give-up internazionale;

- ◊ I contratti ricevuti in regime di give-up internazionale sono riportati senza indicazione di trasferimento. Detti trasferimenti sono comunque evidenziati nei reports MT14, MT15, MT64, MT65 e MT06.

- ◊ eventuali segnalazioni "**POS CHG**" sono da intendersi come interventi di CC&G effettuati al fine di trasferire posizioni futures non presenti sul sistema di clearing in quanto tenute al netto;

- ◊ la colonna "**Serie**" indica le caratteristiche del contratto futures sull'Energia;

- ◊ la colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data nel corso della quale la posizione contrattuale è stata movimentata;

- ◊ la colonna "**Posiz. Aperte**" indica il numero totale delle posizioni Corte o Lunghe;

- ◊ 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;

- ◊ il "**Numero di Riferimento**" indica il numero univoco identificativo del contratto;

- ◊ l'importo del "**Totale Margini di Variazione**" confluisce nei tabulati RP-MS12 e RP-MS11.

2.1.12 RP-MTG5 Posizioni nette per Contratti Futures AGREX

Il tabulato indica la posizione netta di inizio giornata (se presente), i contratti negoziati nel giorno, i margini di variazione e la posizione netta di fine giornata.

Esempio di Tabulato RP-MTG5

```
Ader:  BAN1 BANCA UNO SPA       Posizioni Nette per Contratti Futures AGREX    RP-MTG5  21 AUG 12 19:46:04  Pag.1
                                        COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Conto: EUR - EURO                    Contrattazioni del: 21 AUG 12

                   Precedente    Posiz. Aperte            Acquisti    Prezzo      Prezzo di   Margine        Num.
Serie              Attivita'     Corte  Lunghe  Mkt O/C   Vendite     Prec/Contr  Chiusura    di Variazione  di Rif

      TERZI      *OMN

DWHEAT2H           20AUG12               2                            101,45      101,50          5,00 CR
DWHEAT2H                          4+            X   O       V         101,03      101,50         94,00 DR     900002

  POSIZIONE NETTA ATTUALE         2                                                                89,00 DR

DWHEAT2I           20AUG12               4                            101,65      101,70         10,00 CR
DWHEAT2I                          5+            X   O       V         101,25      101,70        112,50 DR     900004

  POSIZIONE NETTA ATTUALE         1                                                               102,50 DR

                        Totale Margini di Variazione                           EUR             191,50 DR
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ La colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data in cui è stato negoziato il contratto. Nella stessa colonna è possibile inoltre trovare le seguenti voci:

- "**TRF POS**", in caso di posizioni trasferite ad altro Partecipante (segno = "-") o ricevute in trasferimento da altro Partecipante (segno = "+");

- "**TRF TRD**", in caso di contratti trasferiti ad altro Partecipante (segno = "-") o ricevuti in trasferimento da altro Partecipante (segno = "+"), ad eccezione di quelli trasferiti in regime di Give-Up Internazionale;

- "**POS CHG**", in caso di rettifica della posizione da netta a lorda;

- "**POS CA1**", in caso di Consegna Alternativa prima fase;

- "**POS CA2**", in caso di Consegna Alternativa seconda fase.

◊ Nelle colonne "Posizioni Aperte Corte Lunghe" è indicato:

- il numero di posizioni nette aperte (eventuali) di inizio giornata;
- il numero dei lotti di ciascun contratto negoziato nel giorno;
- il numero di posizioni nette aperte di fine giornata (posizione netta attuale).

◊ La colonna "**Mkt**" riporterà la sigla del Mercato per i contratti negoziati nel giorno (X = AGREX).

◊ La colonna "**Acquisti/Vendite**" conterrà "A" in caso di acquisto e "V" in caso di vendita.

◊ La colonna "Prezzo Prec/Contr" potrà contenere i seguenti valori:

- il prezzo di regolamento del giorno precedente, se riferito alle posizioni nette aperte di inizio giornata;
- il prezzo di negoziazione del contratto, se riferito ad un contratto negoziato in giornata.

◊ La colonna "**Prezzo di Chiusura**" conterrà il prezzo di regolamento giornaliero del contratto.

◊ La colonna "**Margine di Variazione**" conterrà il margine di variazione calcolato da CC&G sulla posizione aperta o sul contratto del giorno.

◊ La colonna "**Num. Di Rif**" conterrà il numero di riferimento del contratto negoziato in giornata.

2.1.13 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/  Contratti     Partecipante                Numero di
        Consegna                 Prezzo   Vendita   Negoziati     di Clearing                  Riferimento
Conto : TERZI  *OMN
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.

2.1.14 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 Consegna	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento
Conto : TERZI *OMN							
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.

2.1.15 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	SPMIB SP05	22097		AKDESK
D	C	11:40	Y		111308	27/07/05	33.740,0000	1	P	0000	F	SPMIB SP05	22605		AKDESK
D	C	11:42	Y		111289	27/07/05	33.740,0000	1	P	0000	F	SPMIB SP05	03069		AKDESK
D	C	11:42	Y		111252	27/07/05	33.745,0000	1	P	0000	F	SPMIB SP05	03069	1AANLP	AKDESK
D	C	11:43	N		100245	27/07/05	33.745,0000	1	P	0000	F	SPMIB SP05	03015		AKDESK
R	C	12:18		O	109313	27/07/05	33.775,0000	1	P	0000	F	SPMIB SP05	03131		U35F
R	C	12:18		O	109314	27/07/05	33.775,0000	1	P	0000	F	SPMIB SP05	03131		U35F
R	C	13:57		O	106499	26/07/05	33.690,0000	1	P	0000	F	SPMIB SP05	03249	1AANLP	IT
D	C	17:02	Y		121131	21/07/05	,9495	25	P	0000	O	ENI DC05	23 C 03104	LITOPDE	LITOPDE

- ◊ 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 CC&G del Partecipante controparte del trasferimento.

2.1.16 RP-MC03 Consegne Alternative prima fase

Il tabulato fornisce le informazioni relative alle "Consegne Alternative prima fase" effettuate (nella giornata di T+1) tra i conti/sottoconti del Partecipante e/o tra questi e i conti/sottoconti di altri Partecipanti.

Esempio di Tabulato RP-MC03

```
Mbr:BAN1 BANCA UNO SPA                                Consegne Alternative prima
fase                  RP-MC03                         12 NOV 11       21:57:08
    PAG.1

                  COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

                           Situazione al: 11 NOV 11

Le posizioni sotto indicate sono state oggetto di Consegna Alternativa prima
fase (CA1):

Contratto: DWHEAT FUTURES SU GRANO DURO   NOVEMBRE 2011   Data di regolamento,
entro il: 30 NOV 11

Num.                      Sotto- Posizioni in CA1                Sotto-

Op.       Mbr.  Conto     conto  Lunghe    Corte    Mbr   Conto   conto


0001      BAN1            PROPRIO           *OMN    -3    BAN1    TERZI
          SUB1

0001      BAN1            TERZI     SUB1            -3    BAN1    PROPRIO
          *OMN

0002      BAN1            TERZI     SUB2            -1    BAN8    PROPRIO
          *OMN

0003      BAN1            TERZI     SUB2            -5    BAN6    TERZI
          SUB3

0004      BAN1  TERZI     SUB2      +5              BAN6  TERZI   SUB3


                       Totali       -4       -3
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata di T+2.

◊ La colonna "**Num. Op.**" indica il numero di riferimento dell'operazione; se la consegna alternativa viene effettuata tra due sezioni di conto dello stesso Partecipante, l'operazione viene riportata due volte.

◊ Nelle colonne "**Posizioni in CA1 Lunghe / Corte**" Il segno "**-**" indica la diminuzione delle posizioni Lunghe o Corte determinata dalla "**Consegna Alternativa prima fase**", mentre il segno "**+**" indica l'annullamento (revoca) di una "Consegna Alternativa prima fase" precedentemente immessa nel Sistema.

◊ Le variazioni del numero delle posizioni determinate dalle "Consegne Alternative prima fase" saranno segnalate anche sul Report MTG5 con l'indicazione "**POS CA1**".

2.1.17 RP-MC04 Consegne Alternative seconda fase

Il tabulato fornisce le informazioni relative alle "Consegne Alternative seconda fase" effettuate (nella giornata di T+2 o T+3) tra i conti/sottoconti del Partecipante e/o tra questi e i conti/sottoconti di altri Partecipanti abbinati.

Esempio di Tabulato RP-MC04

```
Mbr:  BAN1   BANCA UNO SPA              Consegne Alternative seconda fase        RP-MC04    12 NOV 11     21:57:08       PAG.  1

                                  COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

                                             Situazione al: 12 NOV 11


Le posizioni sotto indicate sono state oggetto di Consegna Alternativa seconda fase (CA2):


Contratto:  DWHEAT     FUTURES SU GRANO DURO      NOVEMBRE 2011       Data di regolamento, entro il: 30 NOV 11


Rif.               Sotto-  Posizioni iniziali               Pos. abbinate            Sotto-  Posizioni  Posizioni residue Nuovo Rif.
Abbinam.   Conto   conto   Intestato a   Consegna  Ritiro   al Partecipante  Conto   conto   in CA2     Consegna  Ritiro  Abbinamento


1103120001 TERZI    SUB1   MARIO BIANCHI    8               BANCA DUE SPA    TERZI   ERGO      -5             3           1103129002
1103120002 TERZI    SUB2   SERGIO MERLI               10    BANCA UNO SPA    TERZI   SUB3     -10
1103120002 TERZI    SUB3   MARCO NERI      10               BANCA UNO SPA    TERZI   SUB2     -10
                                                                                     ---------------
                                                                                Totali:       -25
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni delle giornate di T+3 e T+4.

◊ La colonna "**Rif. Abbinam**." Indica i numeri degli abbinamenti che sono stati oggetto di "Consegna Alternativa seconda fase"; se la consegna alternativa viene effettuata tra due sezioni di conto dello stesso Partecipante, l'operazione viene riportata due volte.

◊ La colonna "**Intestato a**" indica il nome e cognome o la denominazione sociale dell'intestatario del sottoconto per il quale è stata eseguita la "**Consegna Alternativa seconda fase**".

◊ Le colonne "**Posizioni iniziali Consegna / Ritiro**" indicano il numero delle posizioni in consegna o in ritiro aperte prima dell'esecuzione della "**Consegna Alternativa seconda fase**".

◊ La colonna "**Posizioni in CA2**" indica il numero delle posizioni che sono state oggetto di "Consegna Alternativa seconda fase". L'eventuale segno "**+**" di fronte a tale numero indica la revoca di una "Consegna Alternativa seconda fase" precedentemente immessa nel Sistema.

◊ Le colonne "**Posizioni residue Consegna / Ritiro**" indicano il numero delle posizioni in consegna e in ritiro aperte (non regolate) al termine dell'esecuzione della "Consegna Alternativa seconda fase"; solo in caso di consegna alternativa parziale, tale numero è diverso da zero.

◊ La colonna "**Nuovo Rif. Abbinamento**" indica il nuovo numero di riferimento che l'abbinamento ha assunto a seguito di una "Consegna Alternativa seconda fase" parziale

(per le posizioni non regolate); se la consegna alternativa viene effettuata tra due sezioni di conto dello stesso Partecipante, l'operazione viene riportata due volte.

◊ Le variazioni del numero delle posizioni determinate dalle "**Consegne Alternative seconda fase**" saranno segnalate anche sul Report MTG5 con l'indicazione "**POS CA2**".

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

Ader: GKK Posizioni Aperte OPTIONS RP-MP01 22 JAN 01 21:04:46 Pag. 1

CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Posizioni Iniziali al: 23 JAN 01

Codice	Contratto			Precedente	--------Terzi---------		---------Proprio-------	
ISIN				Attivita'	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   SUB1
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  FNC   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-MPE1 Posizioni Aperte Futures IDEX

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni aperte in futures sull'Energia sulle quali CC&G calcola i margini.

Esempio di Tabulato RP-MPE1

```
Ader: :  GKK                          Posizioni Aperte Futures IDEX        RP-MPE1      3 JAN 01  21:06:39 Pag.  1
                                      CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA


Codice     Contratto Precedente   --------Terzi--------- ---------Proprio-------
ISIN                          Attivita'      Lunghe       Corte      Lunghe       Corte


IT0000000115        M02FB NV077 SEP 07                                            6
M02FB                                        6


IT0000000110        Q01FB DC077 SEP 07       24
Q01FB                                        24
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati sull'Energia ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;

◊ la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN del contratto;

◊ la colonna "**Contratto**" indica il simbolo e la scadenza del contratto;

◊ la colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data nel corso della quale la posizione contrattuale è stata movimentata;

◊ le colonne relative al conto "**Terzi**" e al conto "**Proprio**" indicano il numero di posizioni contrattuali nette aperte in ciascun conto;

◊ il giorno di cascading le posizioni aperte riportate nel presente tabulato tengono conto degli effetti del cascading che vengono illustrati nel dettaglio nel tabulato MPE3. Le posizioni antecedenti al cascading sono riportate nel tabulato MPE2;

◊ il giorno di shifting le posizioni aperte riportate nel presente tabulato non tengono conto degli effetti dello shifting. Le posizioni post-shifting sono riportate nel tabulato MX11.

2.2.8 RP-MPG1 Posizioni Aperte Futures AGREX nei conti

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni aperte Futures AGREX in ciascun conto (Proprio e Terzi). Il dettaglio delle posizioni Futures AGREX aperte nei sottoconti è fornito nel tabulato MPG2.

Esempio di Tabulato RP-MPG1

```
Ader: BAN1 BANCA UNO SPA      Posizioni Aperte Futures AGREX nei conti     RP-MPG1   23 AUG 12  20:09:45 Pag.    1
                             COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
                               Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12

Codice        Contratto           Precedente --------Terzi--------- ---------Proprio-------
Isin                              Attivita'      Lunghe       Corte      Lunghe       Corte

IT0998278678  DWHEAT2H            21 AUG 12                       4           3
IT6473890814  DWHEAT2I            21 AUG 12          15                                  24

              TOTALE POSIZIONI                       15           4                      21
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce;

◊ la colonna "**Contratto**" indica il contratto e la relativa scadenza;

◊ 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 posizioni contrattuali aperte nette, lunghe e corte.

2.2.9 RP-MPG2 Posizioni Aperte Futures AGREX nei sottoconti

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni Futures AGREX registrate nei sottoconti (in modalità segregata) e nelle sezioni omnibus (*OMN) dei conti (in modalità non segregata).

Esempio di Tabulato RP-MPG2

```
Ader: BAN2 BANCA DUE SPA         Posizioni Aperte Futures AGREX nei Sottoconti   RP-MPG2     23 AUG 12  20:09:45 Pag. 1
                                   COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Acct: TERZI   *OMN                  Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12

Codice        Contratto               Precedente ----- Posizioni ------
Isin                                   Attivita'     Lunghe       Corte

IT0998278678  DWHEAT2H               21 AUG 12                     280
IT6473890814  DWHEAT2I               21 AUG 12         445
IT6473890815  DWHEAT2L                3 AUG 12          10

              TOTALE POSIZIONI                         455         280

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
Ader: BAN2 BANCA DUE SPA         Posizioni Aperte Futures AGREX nei Sottoconti   RP-MPG2     23 AUG 12  20:09:45 Pag.  2
                                   COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Acct: TERZI   SUB1                        Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12

Codice        Contratto               Precedente ----- Posizioni ------
Isin                                   Attivita'     Lunghe       Corte

IT0998278678  DWHEAT2H               10 AUG 12           5
IT6473890814  DWHEAT2I                7 AUG 12           4

              TOTALE POSIZIONI                           9

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
Ader: BAN2 BANCA DUE SPA         Posizioni Aperte Futures AGREX nei Sottoconti   RP-MPG2     23 AUG 12  20:09:45 Pag. 3
                                   COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Acct: TERZI   SUB2                        Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12

Codice        Contratto               Precedente ----- Posizioni ------
Isin                                   Attivita'     Lunghe       Corte

IT6473890814  DWHEAT2I                7 AUG 12           1

              TOTALE POSIZIONI                           1

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
Ader: BAN2 BANCA DUE SPA         Posizioni Aperte Futures AGREX nei Sottoconti   RP-MPG2     23 AUG 12  20:09:45 Pag. 4
                                   COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Acct: PROPRIO *OMN                        Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12

Codice        Contratto               Precedente ----- Posizioni ------
Isin                                   Attivita'     Lunghe       Corte

IT0998278678  DWHEAT2H               21 AUG 12         300
IT6473890814  DWHEAT2I               21 AUG 12       1.850
IT6473890815  DWHEAT2L               10 AUG 12                      50

              TOTALE POSIZIONI                       2.150          50
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ 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 il contratto e la relativa scadenza.

◊ 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 nella sezione di conto interessata.

2.2.10 RP-MPE2 Posizioni Aperte Futures IDEX Pre-Cascading

Il tabulato riporta l'elenco di tutte posizioni aperte in futures sull'Energia prima del cascading.

Esempio di Tabulato RP-MPE2

```
Ader: :  GKK                Posizioni Aperte Futures IDEX Pre-Cascading            RP-MPE2      25 SEP 07
21:06:39 Pag.    1
                                                          CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Codice   Contratto        Precedente   --------Terzi--------- ---------Proprio-------
ISIN                               Attivita'      Lunghe       Corte      Lunghe       Corte

IT0000000115     M02FB NV07       11 SEP 07          1

                 M02FB                               1

IT0000000152     M03FB DC07       11 SEP 07          1                       3

                 M03FB                               1                       3

IT0000000110     Q01FB DC07       13 SEP 07          5                       3

                 Q01FB                               5                       3

IT0000000110     Q03FB JN08       13 SEP 07      1.000                   1.002

                 Q03FB                           1.000                   1.002

IT0000000110     Y01FB DC08       13 SEP 07                                  3

                 Y01FB                                                      3
```

- ◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati dell'Energia ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni del giorno successivo a quello di cascading;
- ◊ la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN del contratto;
- ◊ la colonna "**Contratto**" indica il simbolo e la scadenza;
- ◊ la colonna "**Precedente Attività**" indica l'ultima data nella quale la posizione contrattuale è stata movimentata;
- ◊ le colonne "**Terzi**" e "**Proprio**" – "**Lunghe**" e "**Corte**" - indicano le posizioni contrattuali nette prima del cascading;
- ◊ le posizioni aperte successive al cascading, sulle quali sono calcolati i margini, sono indicate nel report MPE1. Il report MPE3 illustra le modifiche alle posizioni dovute al cascading e pertanto rappresenta il raccordo tra il presente report ed il report MPE1.

2.2.11 RP-MPE3 Posizioni Futures IDEX - Cascading

Il tabulato riporta le sostituzioni effettuate nelle posizioni per il meccanismo del cascading.

Esempio di Tabulato RP-MPE3

```
Firm:GKK          Posizioni Futures IDEX - Cascading    RP-MPE3  29 OCT 07 16:56:06 Page 1
Conto : Terzi
Sottoconto                          CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

                                   Data Esecuzione: 29 OCT 07

Posizioni pre-Cascading:    Classe       L/C        Volume      Contratto       Prezzo

                            Q01FB       Lunghe           5       700.000       54,470000

Posizioni post-Cascading:   Classe       L/C        Volume      Contratto       Prezzo

                            M01FB       Lunghe           5+      800.073       54,470000
                            M02FB       Lunghe           5+      800.074       54,470000

                            M03FB       Lunghe           5+      800.075       54,470000
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati dell'Energia ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni del giorno successivo a quello di cascading;

◊ la riga "Posizioni **pre-Cascading**" indica le posizioni del contratto futures sull'Energia oggetto di cascading. L'elenco di tutte le posizioni aperte prima del cascading è contenuto nel report MPE2;

◊ la riga "**Posizioni post-Cascading**" indica le posizioni che sostituiscono, per effetto del cascading, le posizioni di cui alla riga "Posizioni pre-Cascading". Tali posizioni sono ricomprese nel tabulato MPE1 che elenca tutte le posizioni aperte dopo il cascading;

◊ la colonne relative alle: "**Classe**", "**L/C**", "**Volume**", "**Contratto**", "**Prezzo**" indicano rispettivamente:

- "**Classe**" le caratteristiche del contratto;
- "**L/C**" se la posizione è lunga (L) o corta (C);
- "**Volume**" il numero delle posizioni aperte;
- "**Contratto**" indica il numero univoco identificativo del contratto;
- "**Prezzo**" il prezzo di regolamento del contratto.

2.2.12 RP-MX11 Posizioni Futures IDEX Post-Shifting

Il tabulato riporta l'elenco di tutte le posizioni aperte in futures sull'Energia dopo lo shifting, meccanismo di slittamento delle posizioni da una classe ad un'altra che ha luogo dopo il calcolo dei Margini. Il funzionamento dello shifting è descritto nel "Manuale MMeL Marginazione Mercato Elettrico" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

Esempio di Tabulato RP-MX11

```
                              Posizioni Futures IDEX Post-Shifting    MX11    28
DEC 07 18:09:30 Page 1
                                                  CASSA DI COMPENSAZIONE E
GARANZIA


 GCM      :  xxxx     GKK
 Aderente:  xxxx     GKK                                Conto: C    Sottoconto:
*OMN
  Simbolo  Expiry            Strike  P/C F/O      Open Long          Open Short
   D01FB   200801           ,000000       F         100,000
   M01FB   200802           ,000000       F          79,000
   M02FB   200803           ,000000       F         204,000
   Q01FB   200806           ,000000       F                             90,000
   Q02FB   200809           ,000000       F                             40,000
   Y01FB   200912           ,000000       F          81,000
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati sull'Energia ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni del giorno successivo a quello di shifting.

◊ la colonna "**Simbolo**" indica la sigla di negoziazione del contratto futures sull'Energia;

◊ la colonna "**Expiry**" indica la scadenza della posizione contrattuale (in formato AAAA MM);

◊ le colonne **"Open Long e Open Short"** indicano il numero di posizioni lunghe o corte aperte per ciascun contratto a seguito dello shifting.

◊ le posizioni precedenti allo shifting, sulle quali sono calcolati i Margini, sono elencate nel tabulato MPE1.

2.2.13 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.

2.2.14 RP-MP21 Posizioni aperte azioni

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 Liquidaz.	Data Negoziaz.	Cto	L/C	Posizioni Quantit…	Controvalore	Prezzo Riferimento	Controvalore Corrente	Credito/Debito Teorico
AL	18 JUL 02	15 JUL 02	T	L	9.124	74.999,28	8,197000	74.789,42	209,86
BMPS	18 JUL 02	15 JUL 02	T	L	4.300	13.026,00	3,105000	13.351,50	325,50CR
FNC	18 JUL 02	15 JUL 02	T	L	35.000	24.920,00	,757100	26.498,50	1.578,50CR
OL	18 JUL 02	15 JUL 02	T	L	35.056	36.027,23	1,135000	39.788,56	3.761,33CR
SPG	18 JUL 02	15 JUL 02	T	L	18.645	12.119,25	,687500	12.818,43	699,18CR
TIM	18 JUL 02	15 JUL 02	T	L	58.124	247.027,00	4,498000	261.441,75	14.414,75CR
UC	18 JUL 02	15 JUL 02	T	L	27.944	110.658,24	4,058000	113.396,75	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	12.325,00	5,290000	13.225,00	900,00CR
ENEL	19 JUL 02	16 JUL 02	T	C	500	2.575,00CR	5,039000	2.519,50	55,50CR
ENI	19 JUL 02	16 JUL 02	T	C	73	1.043,90CR	14,406000	1.051,63	7,73
G	19 JUL 02	16 JUL 02	T	C	1.497	30.077,59CR	20,590000	30.823,23	745,64
MED	19 JUL 02	16 JUL 02	T	L	3.335	17.342,00	5,721000	19.079,53	1.737,53CR
OL	19 JUL 02	16 JUL 02	T	C	18.761	19.616,91CR	1,135000	21.293,73	1.676,82
SPI	19 JUL 02	16 JUL 02	T	C	703	5.413,10CR	8,136000	5.719,60	306,50
SPM	19 JUL 02	16 JUL 02	T	L	750	4.875,00	6,746000	5.059,50	184,50CR
TI	19 JUL 02	16 JUL 02	T	C	1.020	7.650,00CR	8,201000	8.365,02	715,02
UC	19 JUL 02	16 JUL 02	T	C	1.000	4.010,00CR	4,058000	4.058,00	48,00
UNI	19 JUL 02	16 JUL 02	T	L	310	1.261,70	4,064000	1.259,84	1,86
Saldo liquidazione del: 19 JUL 02			Conto TERZI			34.582,80CR			
BMPS	22 JUL 02	17 JUL 02	T	C	123	382,53CR	3,105000	381,91	,62CR
FDL	22 JUL 02	17 JUL 02	T	C	1.000	11.780,00CR	11,779000	11.779,00	1,00CR
OL	22 JUL 02	17 JUL 02	T	C	19.060	21.290,02CR	1,135000	21.633,10	343,08
TIS	22 JUL 02	17 JUL 02	T	C	1.050	5.523,00CR	5,217000	5.477,85	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.

2.2.15 RP-MC01 Abbinamenti posizioni AGREX in consegna/ritiro

Il tabulato riporta l'elenco degli abbinamenti eseguito da CC&G al termine della giornata di T+1 sulle posizioni in consegna e in ritiro del Partecipante.

Esempio di Tabulato RP-MC01

BAN1 BANCA UNO SPA ABBINAMENTI POSIZIONI AGREX IN CONSEGNA/RITIRO RP-MC01 12 NOV 11 21:57:08 PAG. 1

COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

Situazione al: 12 NOV 11

Valuta: EURO

Contratto: DWHEAT FUTURES SU GRANO DURO NOVEMBRE 2011

Conto: TERZI Sottoconto: MRSS Intestato a: MARIO ROSSI Codice Fiscale: MRRRSSTE78K09G873G Partita IVA:

Abbinamento num. : 1111110001 Data di regolamento, entro il: 30 NOV 11 Luogo di regolamento: SILOS FERRO

Posizioni in Consegna	Status Consegna	Posizioni in Ritiro	Quantità (Ton)	Prezzo di Regolamento	Controvalore Consegna fisica	Tipo Regolam.	Controvalore Cash Settlement
10	COPERTE	0	500	100,00	50.000,00 CR	PHI	,00 CR

DATI DEL PARTECIPANTE ABBINATO:

BAN2 BANCA DUE SPA Qualifica: INDIRETTO Part. Generale: BAN3 BANCA TRE SPA

Conto: TERZI

Sottoconto: DDDD

Intestato a: GIOVANNI ROSSI SIM

Cod. Fiscale:

Partita IVA: T64748394738FGRT7484

Status consegna: RITIRO

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella degli abbinamenti (T+2).

◊ Alla voce "**Abbinamento num.** :" viene indicato il numero di riferimento dell'abbinamento.

◊ La colonna "**Status Consegna**" può contenere i seguenti valori:

- "**COPERTE**", qualora la posizione del Partecipante sia in consegna e quest'ultimo ne abbia comunicato a CC&G la copertura;

- "**NON COPERTE**", qualora la posizione del Partecipante sia in consegna e quest'ultimo non ne abbia comunicato a CC&G la copertura;

- "**IN RITIRO**", qualora la posizione del Partecipante sia in ritiro.

◊ La colonna "**Quantità (Ton)**" indica il numero di tonnellate di sottostante da regolare.

◊ La colonna "**Tipo Regolam.**" può contenere i seguenti valori:

- "**PHI**", qualora il Partecipante in consegna abbia dichiarato la copertura della posizione che sarà pertanto regolata tramite consegna fisica;

- "**CSH**", qualora il Partecipante in consegna non abbia dichiarato la copertura della posizione che sarà pertanto regolata per contanti (cash settlement).

◊ La colonna "**Controvalore Consegna fisica**" indica il controvalore a credito (**CR**) o a debito (**DR**) relativo al contratto da regolare.

◊ La colonna "**Controvalore Cash Settlement**" viene valorizzata solo nel caso in cui il Partecipante in consegna sia inadempiente e abbia quindi posizioni "NON COPERTE" da regolare per contanti (cash settlement).

◊ Nella sezione "**Dati del Partecipante abbinato**", saranno indicati i dati del Partecipante abbinato purché quest'ultimo non sia inadempiente e non abbia quindi posizioni in consegna non coperte. In caso di inadempimento del Partecipante abbinato, in luogo dei dati di quest'ultimo verrebbe indicato "CC&G" ed il regolamento della posizione avverrebbe per contanti (cash settlement).

2.2.16 RP-MC02 Posizioni AGREX in consegna regolate e da regolare

Il tabulato riporta l'elenco delle posizioni Futures AGREX in consegna/ritiro regolate nella giornata e quelle ancora non regolate.

Esempio di Tabulato RP-MC02

```
BAN1 BANCA UNO SPA            POSIZIONI AGREX IN CONSEGNA REGOLATE E DA REGOLARE          RP-MC02   12 NOV 11   21:57:08     PAG. 1
                                   COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
                                           Situazione al: 12 NOV 11
Valuta:  EURO

Contratto:   DWHEAT     FUTURES SU GRANO DURO     NOVEMBRE 2011

Conto: TERZI    Sottoconto: MRSS   Intestato a: MARIO ROSSI    Codice Fiscale: MRRRSSTE78K09G873G   Partita IVA:

Abbinamento num.: 1111110001       Data di regolamento, entro il: 30 NOV 11       Luogo di regolamento:  SILOS FERRO

                                   Posticipo termini di consegna (Y/N): N         Data di regolamento posticipata al:

Posizioni in    Posizioni  Quantità  Prezzo di      Controvalore      Tipo      Controvalore       Ritirato    Accettato   Regolato
Consegna        in Ritiro    (Ton)   Regolamento    Consegna fisica   Regolam.  Cash Settlement       (Y/N)        (Y/N)       (Y/N)
   10              0          500       100,00         50.000,00 CR     PHI                  ,00 CR      N            N           N

DATI DEL PARTECIPANTE ABBINATO:

BAN2  BANCA DUE SPA          Qualifica: INDIRETTO     Part. Generale:  BAN3   BANCA TRE SPA
Conto:    TERZI
Sottoconto:  DDDD
Intestato a:  GIOVANNI ROSSI SIM
Cod. Fiscale:
Partita IVA: T64748394738FGRT7484
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ Alla voce "**Abbinamento num.** :" viene indicato il numero di riferimento dell'abbinamento.

◊ Alla voce "**Posticipo termini di consegna (Y/N)**" viene indicato se la data di regolamento dell'abbinamento è stata posticipata rispetto a quella originaria.

◊ Alla voce "**Data di regolamento posticipata al**:" viene indicata la nuova data di regolamento dell'abbinamento, se questa è stata posticipata rispetto a quella originaria.

◊ La colonna "**Controvalore Consegna fisica**" indica il controvalore a credito (CR) o a debito (DR) relativo al contratto da regolare.

◊ La colonna "**Tipo Regolam.**" può contenere i seguenti valori:

- "**PHI**", nel caso in cui il contratto debba regolarsi o sia stato regolato tramite consegna fisica;

- "**CSH**", nel caso in cui il contratto sia stato regolato per contanti (cash settlement);

- "**CA2**", nel caso in cui il contratto sia stato regolato tramite "Consegna Alternativa seconda fase".

◊ La colonna "**Controvalore Cash Settlement**" viene valorizzata solo nel caso in cui il contratto è regolato per contanti (cash settlement) a causa della non adeguata qualità della merce consegnata ed indica il controvalore a credito (CR) o a debito (DR) da regolare nei confronti di CC&G.

◊ La colonna "**Ritirato (Y/N)**" indica se il Partecipante in ritiro ha ritirato la merce;

◊ La colonna "**Accettato (Y/N)**" indica se il Partecipante in ritiro ha accettato la merce ritirata (Ritirato = Y, Accettato = Y) o l'ha sottoposta al controllo della qualità (Ritirato = Y, Accettato = N).

◊ La colonna "**Regolato (Y/N)**" indica se il contratto è stato regolato in giornata (Y) o se è ancora da regolare (N). Il valore sarà "**Y**" sia in caso di regolamento fisico, sia in caso di regolamento per contanti.

◊ Nella sezione "**Dati del Partecipante abbinato**", saranno indicati i dati del Partecipante abbinato a meno che il contratto non sia stato regolato per contanti (cash settlement); in tal caso, in luogo del Partecipante abbinato è indicato "CC&G".

2.2.17 RP-MC06 Posizioni in vendita AGREX

Il tabulato riporta le posizioni aperte Futures AGREX in vendita e le informazioni sulla relativa copertura.

Esempio di Tabulato RP-MC06

```
Mbr:  BAN1            Posizioni Futures AGREX in vendita     RP-MC06  10 NOV 11
21:23:22  PAG.  1          COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
                           Posizioni al: 10 NOV 11


Contratto:  DWHEAT      FUTURES SU GRANO DURO   NOVEMBRE 2011


Conto:  TERZI


Sotto-        Posizioni Luogo di       Posizioni   Posizioni
conto    in vendita     consegna             coperte     non coperte


*OMN       10        SF            8          2
SUB1       5         SF            5


Conto: PROPRIO


Sotto-        Posizioni Luogo di       Posizioni   Posizioni
conto    in vendita     consegna             coperte     non coperte


*OMN       3         SF            2          1
FIL1       4         SF            4
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ Alla voce "**Conto**:" viene indicato il conto (Proprio o Terzi) di riferimento delle posizioni in vendita sotto indicate.

◊ La colonna "**Sottoconto**:" indica la sezione del conto dove sono registrate le posizioni in vendita (omnibus o sottoconto).

◊ La colonna "**Posizioni in vendita**" indica il numero delle posizioni in vendita registrate nella sezione del conto.

◊ La colonna "**Luogo di consegna**" indica il luogo di consegna fisica della merce sottostante le posizioni (SF = Silos Ferro).

◊ La colonna "**Posizioni coperte**" indica il numero di posizioni in vendita coperte.

◊ La colonna "**Posizioni non coperte**" indica il numero di posizioni in vendita non coperte.

2.2.18 RP-MC07 Posizioni in vendita non coperte AGREX

Il tabulato riporta le posizioni aperte Futures AGREX in vendita relativamente alle quali il Partecipante non ha comunicato a CC&G la copertura presso il luogo di consegna e sulle quali sono applicati i margini iniziali maggiorati.

Esempio di Tabulato RP-MC07

```
Mbr: BAN1       Posizioni Futures AGREX in vendita non coperte  RP-MC07  10 NOV
11  21:03:23  PAG. 1

                  COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

                          Situazione al: 10 NOV 11


Si informa che alle seguenti posizioni non coperte sono applicati i margini
iniziali maggiorati.

Le posizioni non coperte entro le ore 12:00 del 13 NOV 11 saranno regolate per
contanti.


Contratto: DWHEAT       FUTURES SU GRANO DURO   NOVEMBRE 2011


Conto:   TERZI


Sotto-        Posizioni Luogo di       Posizioni   Posizioni
conto    in vendita     consegna             coperte     non coperte


*OMN       10               SF                   8        2


Conto: PROPRIO


Sotto-        Posizioni Luogo di       Posizioni   Posizioni
conto    in vendita     consegna             coperte     non coperte


*OMN             3          SF                     2      1
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole dal quarto giorno precedente la scadenza (T-4) fino al giorno di scadenza incluso (T) ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ Alla seconda riga è indicato l'orario e il giorno limite per la comunicazione di copertura, superato il quale le posizioni saranno regolate da CC&G per contanti.

◊ Alla voce "**Conto**:" viene indicato il conto (Proprio o Terzi) di riferimento delle posizioni in vendita sotto indicate.

◊ La colonna "**Sottoconto**:" indica la sezione del conto dove sono registrate le posizioni in vendita non coperte (omnibus o sottoconto).

◊ La colonna "**Posizioni in vendita**" indica il numero delle posizioni in vendita registrate nella sezione del conto.

◊ La colonna "**Luogo di consegna**" indica il luogo di consegna fisica della merce sottostante le posizioni (SF = Silos Ferro).

◊ La colonna "**Posizioni coperte**" indica il numero di posizioni in vendita coperte.

◊ La colonna "**Posizioni non coperte**" indica il numero di posizioni in vendita non coperte, a cui sono applicati i Margini iniziali maggiorati.

2.2.19 RP-MC08 Contratti Futures AGREX regolati nel giorno

Il tabulato riporta i contratti Futures AGREX regolati nel giorno.

Esempio di Tabulato RP-MC08

BAN1 BANCA UNO SPA CONTRATTI FUTURES AGREX REGOLATI NEL GIORNO RP-MC08 12 NOV 11 21:57:08 PAG. 1

COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

Situazione al: 12 NOV 11

Valuta: EURO

Contratto: DWHEAT FUTURES SU GRANO DURO NOVEMBRE 2011

Conto: TERZI Sottoconto: MRSS Intestato a: MARIO ROSSI Cod. Fiscale: MRRRSSTE78K09G873G Part. IVA:

Abbinamento num. : 1111110001 Data di regolamento, entro il: 30 NOV 11 Luogo di regolamento: SILOS FERRO

Posticipo termini di consegna (Y/N): N Data di regolamento posticipata al:

Posizioni in Consegna	Posizioni in Ritiro	Quantità (Ton)	Prezzo di Regolamento	Controvalore Consegna fisica	Tipo Regolam.	Controvalore Cash Settlement
10	0	500	100,00	50.000,00 CR	PHI	,00 CR

DATI DEL PARTECIPANTE ABBINATO:

BAN2 BANCA DUE SPA Qualifica: INDIRETTO Part. Generale: BAN3 BANCA TRE SPA

Conto: TERZI

Sottoconto: DDDD

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ La colonna "**Tipo Regolam.**" può contenere i seguenti valori:

- "**PHI**", nel caso in cui il contratto sia stato regolato tramite consegna fisica;
- "**CSH**", nel caso in cui il contratto sia stato regolato per contanti (cash settlement);

- "**CA2**", nel caso in cui il contratto sia stato regolato tramite "Consegna Alternativa seconda fase".

◊ Nella sezione "**Dati del Partecipante abbinato**", saranno indicati i dati del Partecipante abbinato a meno che il contratto non sia stato regolato per contanti (cash settlement); in tal caso, in luogo del Partecipante abbinato è indicato "CC&G".

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 XXXXXX                    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 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 CC&G 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 CC&G, 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
_____________________________________________________________________________________________________________________________
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
    00001   FR0010163543  OAT APR15 EUR 3,5        OAT     15.000.000,00  103,66  7,00 % 31  14.460.570,00   2014/02/05   2015/04/25
    00002   FR0120746609  BTAN TF 1% LG17 EUR      BTAN    26.000.000,00  101,63  7,00 % 32  24.574.134,00   2014/02/05   2017/07/25
                                                   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
_____________________________________________________________________________________________________________________________
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
    00003   IT0004321813  CCTS 0.420  01/12/14     CCT        9.000.000  100,17  3,5%  03    8.496.920,25   2014/02/05   2014/12/01
    00004   IT0004953417  BTPS 4.500  01/03/24     BTP       70.000.000  109,60  3,5%  09   63.294.000,00   2014/02/05   2024/03/01
                                                   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
_____________________________________________________________________________________________________________________________
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 CC&G 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 dei 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 CC&G richieda Margini Aggiuntivi Infragiornalieri dopo l'orario indicato all'Art B.3.1.2, comma 1, lettera c, delle Istruzioni.

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 CC&G 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 CC&G 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 CC&G richieda 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
_____________________________________________________________________________________________________________________
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
_____________________________________________________________________________________________________________________
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
_____________________________________________________________________________________________________________________
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
_____________________________________________________________________________________________________________________
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. CC&G 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 CC&G 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 dei 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");

- ◊ 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, 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.Ades.   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.Ades.   Ragione Sociale               Codice     Causale               Ammontare

BANU/5099 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/8877 TERZI    Diretto   CBCB CONTO ISA                 18877     MIF ADG            3.135.197,96
BABB/9988 PROPRIO  Segregato BABBI & C.SPA 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.Ades** è indicato "Diretto" se il pagamento è riferito ad un Partecipate 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;
- **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 Obbliazionario e Obbligazionario ICSD ;
- **BOR MEL** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia;
- **BOR MAG** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo al Comparto Derivati su Commodities Agricole;
- **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 Obbliazionario e Obbligazionario ICSD;
- **BOR IEL** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per il Comparto Derivati dell'Energia;
- **BOR IAG** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per il Comparto Derivati su Commodities Agricole.

◊ 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 Page    1
                                                Contrattazioni Del: 29 FEB 16


Valuta:   EUR - EURO


I seguenti importi a debito saranno regolati con valuta odierna 1 MAR 16:


Aderente  Conto    T.Ades.   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.:BANU BANCA UNO 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.Ades.   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.Ades** è indicato "Diretto" se il pagamento è riferito al Partecipate 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;
- **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 Obbliazionario e Obbligazionario ICSD;
- **BOR MEL** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia;
- **BOR MAG** = regolamento delle Quote di Contribuzione al Default Fund relativo al Comparto Derivati su Commodities Agricole;
- **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 Obbliazionario e Obbligazionario ICSD;
- **BOR IEL** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per il Comparto Derivati dell'Energia;
- **BOR IAG** = regolamento degli interessi relativi alla contribuzione al Default Fund per il Comparto Derivati su Commodities Agricole.

◊ 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.

      XXXXXXXXXXXXXXXXXXX               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

                                   --------------------     --------------------
Importo A Credito/Debito                   88.500,00DR                     ,00
```

- ◊ 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, RP-MTE5, RP-MTG5
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 XXXXXXXXXXXXXX                    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-MS22 Margini Iniziali Comparti Azionario e Derivati Azionari

Il tabulato illustra gli importi dei Margini iniziali relativi ai Comparti Azionario e Derivati Azionari calcolati in ciascun conto (Proprio e Terzi) in base alle posizioni contrattuali, prezzi di chiusura e valori teorici.

Esempio di Tabulato RP-MS22

```
Ader.:GKK      Margini Iniziali Comparti Azionario e Derivati Azionari    RP-MS22    2 APR 03 13:10:03   PAGE    1

Valuta:   EURO                                  CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto:   TERZI  *OMN       Gruppo Mercati:MTA           Contrattazioni Del: 15 JUL 05
Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle       Margini        Margini
                              Ammont.TIM       Cop./Str.        Ordin.    Premio/MIM      Consegna    Addizionali        Totali
C AL          19 JUL 2005                                      9.697C        229,85C
C AL          20 JUL 2005                                      1.327C          6,49
C AL          21 JUL 2005                                         44C          3,75C
F AL     T/A  20 JUL 2005          ,0480                         13L        312,00
F AL     AG 05                   9,0151                          30L                        0,00
O AL     JY 05      9 CALL
   OPEN E/A  20 JUL 05           0,0020                          3E          3,00C
O AL     AG 05    9,5 CALL       0,0287                          2C         28,70
O AL     AG 05     10 CALL       0,0041                         50L        102,50C
O AL     SP 05     10 CALL       0,0182                         26L        236,60C
O AL     DC 05    8,6 CALL       0,6549                         20L      6.549,00C
O AL     DC 05      9 CALL       0,4054                         17L      3.445,90C
O AL     DC 05    9,5 CALL       0,1909                         45L      4.295,25C
O AL     SP 05    8,6 PUT        0,0770                          1C         38,50
ALLEANZA ASS                                                             14.480,16C          0,00           0,00

Grp.Prod.  Offset             Mrg.Minimo:                                  14.480,16C          0,00      21.954,34
         7.474,18

Conto:  TERZI   EURO                  Valuta:         1,00000000                                                  7.474,18
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;

◊ i Partecipanti che abbiano richiesto, anche a solo titolo informativo, che CC&G calcoli i Margini anche separatamente per i comparti Azionario e Derivati Azionari, riceveranno anche il report MS42 (vedi esempio nel seguito) contenente il calcolo separato dei margini;

◊ i Partecipanti che abbiano chiesto, anche a solo titolo informativo, che CC&G calcoli i Margini separatamente per ciascun sottoconto, riceveranno anche il report MS24 (vedi esempio nel seguito) contenente il calcolo separato dei margini per sottoconto;

◊ il simbolo nella prima colonna individua il tipo di contratto e quindi il Comparto di appartenenza. Per il Comparto Derivati Azionari: F = futures, O = opzioni. Per il Comparto Azionario: C = azioni, W = warrant, V = obbligazioni convertibili.

◊ le posizioni corte call in opzioni su azioni e le posizioni futures corte coperte (Colonna "Posiz. Cop./") dal deposito di azioni sottostanti non sono soggette a Margini iniziali;

◊ il tabulato indica anche le posizioni contrattuali in opzioni esercitate/assegnate (OPEN E/A) e le posizioni futures in consegna (T/A) in quanto soggette a Margini iniziali;

◊ per ulteriori dettagli sulle modalità di determinazione dei Margini iniziali relativi ai Comparti Azionario e Derivati Azionari si rimanda al Manuale TIMS.

2.4.7 RP-MS24 Marginazione separata Sottoconti Comparti Azionario e Derivati Azionari

Il tabulato illustra gli importi dei Margini iniziali relativi ai Comparti Azionario e Derivati Azionari, calcolati in ciascun conto (Proprio e Terzi) e in ciascuna sezione di conto (sezione Omnibus e sottoconti) in base alle posizioni contrattuali, prezzi di chiusura e valori teorici.

Esempio di Tabulato RP-MS24

```
Ader.:GKK     Marginazione separata Sottoconti Azionario e Derivati Azionari RP-MS24 15 JAN 08 00:24:19    PAGE  1
Valuta:   EURO                          CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
                                          Contrattazioni Del: 14 JAN 08

Conto:   TERZI *OMN  Gruppo Mercati:NET

Descrizione Contratto  Prezzo/   Posiz.    Nette/    Margini su   Straddle     Margini        Margini
                   Ammont.ITM  Cop./Str.  Ordin.    Premio/MTM   Consegna   Addizionali        Totali

C UBI     29 JAN 2008                     1.000C        730,00
C UBI     30 JAN 2008                     3.500C        175,72C
C UBI     31 JAN 2008                     5.000C        170,00C
F UBI   FB 08          16,2329               38L                      0,00
O UBI   MR 08 17 PUT    1,0821              300C    162.315,00
O UBI   JN 08 17 PUT    1,8447              300L    276.705,00C
UNIONE BANCHE ITALIANE                              114.005,72C      0,00          0,00
Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:          114.005,72C      0,00     18.605,25     95.400,47C


Conto:   TERZI SUB1  Gruppo Mercati:NET

Descrizione Contratto  Prezzo/   Posiz.    Nette/    Margini su   Straddle     Margini        Margini
                   Ammont.ITM  Cop./Str.  Ordin.    Premio/MTM   Consegna   Addizionali        Totali

F MINI MR 08            34065                45S                      0,00
O SPMIB JN 08 30000 PUT   860                 5S     10.750,00
O SPMIB JN 08 34000 PUT  2374                30S    178.050,00
O SPMIB DC 08 25000 PUT   615                60S     92.250,00
MINIFUTURE SU INDICE DI BORSA                       281.050,00      0,00          0,00
Grp.Prod.  Offset             Mrg.Minimo:           281.050,00      0,00     86.861,05     367.911,05


Totale Conto: TERZI   EURO    Currency:    1,00000000                                     367.911,05
```

◊ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;

◊ il simbolo nella prima colonna individua il tipo di contratto e quindi il Comparto di appartenenza. Per il Comparto Derivati Azionari: F = futures, O = opzioni. Per il Comparto Azionario: C = azioni o ETF, W = warrant, V = obbligazioni convertibili.

◊ le posizioni corte call in opzioni su azioni e le posizioni futures corte coperte (Colonna "Posiz. Cop./") dal deposito di azioni sottostanti non sono soggette a Margini iniziali;

◊ il tabulato indica anche le posizioni contrattuali in opzioni esercitate/assegnate (OPEN E/A) e le posizioni futures in consegna (T/A) in quanto soggette a Margini iniziali;

◊ per ulteriori dettagli sulle modalità di determinazione dei Margini iniziali per i Comparti Azionario e Derivati Azionari si rimanda al Manuale TIMS disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

2.4.8 RP-MS42 Margini Iniziali calcolati separatamente per Comparto

Il tabulato illustra gli importi dei Margini iniziali calcolati separatamente per ciascun Comparto (Derivati Azionari ed Azionario).

Esempio di Tabulato RP-MS42

```
Ader.:GKK            Margini inziali calcolati separatamente per Comparto       RP-MS42    2 APR 03 13:27:33   PAGE    1
Valuta:   EURO                                  CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto:   PROPRIO *OMN   Gruppo Mercati:MTA          Contrattazioni Del: 18 JUL 05
Descrizione Contratto          Prezzo/        Posiz.        Nette/   Margini su     Straddle       Margini       Margini
                             Ammont.TTM      Cop./Str.      Ordin.   Premio/MTM     Consegna    Addizionali        Totali

F AL     T/A  20 JUL 2005        ,0480                       13L        312,00
F AL     AG 05                  9,0151                       30L                        0,00
O AL     JY 05      9 CALL
   OPEN E/A  20 JUL 05          0,0020                        3E          3,00C
O AL     AG 05    9,5 CALL      0,0287                        2C         28,70
O AL     AG 05     10 CALL      0,0041                       50L        102,50C
O AL     SP 05     10 CALL      0,0182                       26L        236,60C
O AL     DC 05    8,6 CALL      0,6549                       20L      6.549,00C
O AL     DC 05      9 CALL      0,4054                       17L      3.445,90C
O AL     DC 05    9,5 CALL      0,1909                       45L      4.295,25C

O AL     SP 05    8,6 PUT       0,0770                        1C         38,50
ALLEANZA ASS                                                         14.253,05C         0,00          0,00

Grp.Prod.  Offset             Mrg.Minimo:                            14.253,05C         0,00     28.430,57     14.177,52

Totale Conto:  PROPRIO   EURO                  Valuta:        1,00000000                                          14.177,52

Ader.:xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx                       Settlment separato                  RP-MS42    2 APR 03 13:27:33   PAGE    2
Valuta:   EURO                                  CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto:   PROPRIO *OMN   Gruppo Mercati:MTA          Contrattazioni Del: 18 JUL 05
Descrizione Contratto          Prezzo/        Posiz.        Nette/   Margini su     Straddle       Margini       Margini
                             Ammont.TTM      Cop./Str.      Ordin.   Premio/MTM     Consegna    Addizionali        Totali

C AL          19 JUL 2005                                   9.697C        229,85C
C AL          20 JUL 2005                                   1.327C          6,49
C AL          21 JUL 2005                                      44C          3,75C
ALLEANZA ASS                                                            227,11C         0,00          0,00

Grp.Prod.  Offset             Mrg.Minimo:                               227,11C         0,00      6.476,23      6.249,12

Totale Conto:  PROPRIO   EURO                  Valuta:        1,00000000                                           6.249,12
```

◊ Il tabulato è soggetto al pagamento di un corrispettivo mensile, per tutti i Partecipanti che lo richiedano "a solo titolo informativo"; lo stesso è invece gratuito per i Partecipanti che richiedano che i pagamenti del regolamento giornaliero siano determinati sulla base di un calcolo separato dei margini iniziali tra i Comparti Azionario e Derivati Azionari;

◊ il simbolo nella prima colonna individua il tipo di contratto e quindi il Comparto di appartenenza. Per il Comparto Derivati Azionari: "F" = futures, "O" = opzioni. Per il Comparto Azionario: "C" = azioni o ETF, "W" = warrant, "V" = obbligazioni convertibili.

◊ le posizioni corte call in opzioni su azioni coperte (Colonna "Coper.") dal deposito di azioni sottostanti non sono soggette a Margini iniziali;

◊ il tabulato indica anche le posizioni contrattuali in opzioni esercitate/assegnate (OPEN E/A), in quanto soggette a Margini iniziali;

◊ per ulteriori dettagli sulle modalità di determinazione dei Margini iniziali per i Comparti Azionario e Derivati Azionari si rimanda al Manuale TIMS disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

2.4.9 RP-MSE2 Margini Iniziali Comparto Derivati dell'Energia

Il tabulato illustra l'importo dei Margini Iniziali calcolato sulle posizioni aperte in futures sull'Energia.

Esempio di Tabulato RP-MSE2

```
Ader.:GKK                                  Margini Inziali Comparto Derivati dell'Energia       RP-MSE2    1 SEP 08 17:32:52   Page 1
Valuta:   EURO                                   CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto:   TERZI   *OMN  Gruppo Mercati:IDEX          Contrattazioni Del: 25 JAN 08
Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle        Margini        Margini
                             Ammont.ITM        Cop./Str.        Ordin.    Premio/MTM      Consegna    Addizionali         Totali

F M01FB  FB 08                   39,73                            2L                          0,00
FUTURE EL MESE 1                                                                  0,00        0,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                        0,00        0,00       8.295,62       8.295,62


F M02FB  MR 08                   67,12                            2L                          0,00
FUTURE EL MESE 2                                                                  0,00        0,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                        0,00        0,00       9.974,03       9.974,03


 F Q01FB  JN 08                   65,87                            3L                          0,00
 FUTURE EL TRIMESTRE 1                                                             0,00        0,00           0,00


 F Q02FB  SP 08                   66,98                            3L                          0,00
 FUTURE EL TRIMESTRE 2                                                             0,00        0,00           0,00


 F Q03FB  DC 08                   58,24                            3L                          0,00
 FUTURE EL TRIMESTRE 3                                                             0,00        0,00           0,00

 Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                        0,00        0,00     114.300,62     114.300,62

 Totale Conto:  TERZI   EURO                   Valuta:        1,00000000                                                132.570,27
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Derivati dell'Energia ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;

◊ la colonna "**Descrizione Contratto**" indica il simbolo del contratto futures sull'Energia;

◊ la colonna "**Prezzo**" indica il prezzo di regolamento giornaliero;

◊ la colonna "**Nette/Ordin**" indica il numero delle posizioni corte (C) o lunghe (L);

◊ la colonna "**Margini Addizionali**" indica l'importo dei Margini Addizionali. Per ulteriori dettagli relativi alla modalità di determinazione di tale importo si rimanda al "Manuale MMeL Marginazione Mercato Elettrico" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**;

◊ la colonna "**Margini Totali**" riporta l'ammontare complessivo dei Margini Iniziali calcolato come somma algebrica tra i "Margini Mark to Market" e i "Margini Addizionali".

2.4.10 RP-MSE4 Margini Iniziali posizioni Futures IDEX in consegna

Il tabulato illustra l' importo dei Margini Iniziali sulle posizioni futures sull'Energia in consegna.

Esempio di Tabulato RP-MSE4

```
Ader.:GKK                    Margini Inziali posizioni Futures IDEX in consegna     RP-MSE4     30 JUL 08   16:46:14     Page   1
                                CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Valuta:   EURO
Conto:   TERZI   *OMN  Gruppo Mercati:IDEX        Contrattazioni Del:  2 JAN 08
Descrizione Contratto        Prezzo/        Posiz.        Nette/   Margini su   Straddle      Margini        Margini
                    Ammont.ITM      Cop./Str.      Ordin.   Premio/MTM   Consegna   Addizionali      Totali

F D01FB  JA 08              50,00                    100L    897.264,00
FUTURE EL IN CONSEGNA                                        897.264,00          0,00        0,00

Grp.Prod.  Offset          Mrg.Minimo:                       897.264,00          0,00    1.116.000,00     2.013.264,00

Totale Conto:  TERZI   EURO              Valuta:       1,00000000                                          2.013.264,00
```

- ◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- ◊ la colonna "**Descrizione Contratto**" indica la sigla di negoziazione e la scadenza del contratto futures sull'Energia;
- ◊ la colonna "**Prezzo**" indica il prezzo di regolamento giornaliero;
- ◊ la colonna "**Nette/Ordin**" indica il numero delle posizioni nette corte (C) o lunghe (L);
- ◊ la colonna "**Margini su Premio / MTM**" indica i Margini Mark to Market;
- ◊ la colonna "**Margini Addizionali**" indica l'importo dei Margini Addizionali. Per ulteriori dettagli relativi alla modalità di determinazione di tale importo si rimanda al "Manuale MMeL Marginazione Mercato Elettrico" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**;
- ◊ la colonna "**Margini Totali**" riporta l'ammontare complessivo dei margini iniziali sulle posizioni in futures sull'Energia in consegna calcolato come somma algebrica tra Margini Mark to Market e i Margini Addizionali.

2.4.11 RP-MSE6 Marginazione separata Sottoconti IDEX – posizioni ordinarie

Il tabulato illustra gli importi dei Margini iniziali relativi al Comparto Derivati dell'Energia calcolati separatamente in ciascun conto (Proprio e Terzi) e in ciascuna sezione di conto (sezione Omnibus e sottoconti) in base alle posizioni contrattuali ordinarie, ai prezzi di regolamento giornaliero e ai valori teorici.

Esempio di Tabulato RP-MSE6

```
Ader.:GKK      Marginazione separata Sottoconti IDEX - pos. ord. RP-MSE6  1 AUG 08 19:11:17  Page  1
                                                                    CASSA DI COMPENSAZIONE E
GARANZIA

Valuta:  EURO
Conto:   TERZI   *OMN  Gruppo Mercati:IDEX          Contrattazioni Del:  3 JAN 08
Descrizione Contratto Prezzo/     Posiz.    Nette/   Margini su  Straddle  Margini      Margini
                      Ammont.ITM  Cop./Str. Ordin.   Premio/MTM  Consegna  Addizionali  Totali

F M01FB  FB 08        35,43                 79L      0,00
FUTURE EL MESE 1                                     0,00        0,00      0,00

Grp.Prod.  Offset     Mrg.Minimo:                    0,00        0,00      292.212,47   292.212,47


F M02FB  MR 08        64,37                 204L                0,00
FUTURE EL MESE 2                                     0,00        0,00      0,00

Grp.Prod.  Offset     Mrg.Minimo:                    0,00        0,00      975.668,96   975.668,96
F Q01FB  JN 08        56,08                 90C                 0,00
FUTURE EL TRIMESTRE 1                                0,00        0,00      0,00


F Q02FB  SP 08        61,02                 40C                 0,00
FUTURE EL TRIMESTRE 2                                0,00        0,00      0,00


F Y01FB  DC 09        38,97                 81L                 0,00
FUTURE EL ANNO 1                                     0,00        0,00      0,00

Grp.Prod.  Offset     Mrg.Minimo:                    0,00        0,00      2.893.136,69 2.893.136,69

Totale Conto:  TERZI   EURO       Valuta:   1,00000000                                  4.161.018,12
```

◊ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;

◊ per ulteriori dettagli sulle modalità di determinazione dei Margini iniziali per il Comparto Derivati dell'Energia si rimanda al "Manuale MMeL Marginazione Mercato Elettrico" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

2.4.12 RP-MSE8 Marginazione separata Sottoconti IDEX – posizioni in consegna

Il tabulato illustra gli importi dei Margini iniziali relativi al Comparto Derivati dell'Energia calcolati separatamente in ciascun conto (Proprio e Terzi) e in ciascuna sezione di conto (sezione Omnibus e sottoconti) in base alle posizioni contrattuali in consegna, ai prezzi di chiusura e ai valori teorici.

Esempio di Tabulato RP-MSE8

```
Ader.:GKK     Marginazione separata Sottoconti IDEX - pos. cons.  RP-MSE8  1 AUG 08 19:11:17  PAGE 1
                                  CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Valuta:   EURO
Conto:   TERZI   *OMN  Gruppo Mercati:IDEX            Contrattazioni Del:  3 JAN 08
Descrizione Contratto Prezzo/     Posiz.    Nette/ Margini su  Straddle  Margini      Margini
                      Ammont.ITM  Cop./Str. Ordin. Premio/MTM  Consegna  Addizionali  Totali

F D01FB  JA 08        62,06                 100L   0,00
FUTURE EL IN CONSEGNA                               0,00        0,00      0,00

Grp.Prod.  Offset     Mrg.Minimo:                   0,00        0,00      1.385.179,20 1.385.179,20

Totale Conto:  TERZI   EURO                 Valuta: 1,00000000                         1.385.179,20
```

◊ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;

◊ per ulteriori dettagli sulle modalità di determinazione dei Margini iniziali per il Comparto Derivati dell'Energia, si rimanda al "Manuale MMeL Marginazione Mercato Elettrico" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

2.4.13 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 Contratto	Data Contratto	Data Regolam.	Quantità	Controvalore	Repo	Tasso Repo	Group Regol	Grou 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 CC&G 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 CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

2.4.14 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*

2.4.15 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.*

2.4.16 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

Classe	Posizione Lunga	ABBATTIMENTO INTRA CLASSE 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

Classe	Posizione Lunga	ABBATTIMENTO INTRA CLASSE 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*

2.4.17 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

Priorità	Classe A — B			ABBATTIMENTO INTER CLASSE Classe A Posizione Lunga	Posizione Corta	Percentuale Riduzione	Classe B Posizione Lunga	Posizione Corta
001	02	03	ES	0	0	20,00%	0	0
002	03	04	ES	0	0	40,00%	0	0
003	04	05	ES	0	0	40,00%	0	0
004	04	06	ES	0	0	20,00%	0	0
005	05	06	ES	0	0	40,00%	0	0
006	05	07	ES	0	0	25,00%	0	0
007	06	07	ES	0	0	45,00%	0	0
008	06	08	ES	0	0	25,00%	0	0
009	06	09	ES	0	0	15,00%	0	0
010	07	08	ES	0	0	45,00%	0	0
011	07	09	ES	0	0	30,00%	0	0
012	07	10	ES	0	0	20,00%	0	0
013	08	09	ES	0	0	50,00%	0	0
014	08	10	ES	0	0	35,00%	0	0
015	09	10	ES	0	0	55,00%	0	0
016	09	11	ES	0	0	25,00%	14.847.577	0
017	10	11	ES	0	0	40,00%	14.847.577	0

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 : IT ITALY

Priorità	Classe A — B			ABBATTIMENTO INTER CLASSE Classe A Posizione Lunga	Posizione Corta	Percentuale Riduzione	Classe B Posizione Lunga	Posizione Corta
001	02	03	IT	0	0	20,00%	0	0
002	03	04	IT	0	0	35,00%	0	0
003	04	05	IT	0	0	40,00%	0	0
004	04	06	IT	0	0	20,00%	2.248.210	0
005	05	06	IT	0	0	40,00%	2.248.210	0
006	05	07	IT	0	0	25,00%	0	0
007	06	07	IT	2.248.210	0	45,00%	0	0
008	06	08	IT	2.248.210	0	25,00%	0	0
009	06	09	IT	2.248.210	0	15,00%	0	0
010	07	08	IT	0	0	45,00%	0	0
011	07	09	IT	0	0	30,00%	0	0
012	07	10	IT	0	0	20,00%	0	0
013	08	09	IT	0	0	50,00%	0	0
014	08	10	IT	0	0	35,00%	0	0
015	09	10	IT	0	0	50,00%	0	0
016	09	11	IT	0	0	30,00%	1.312.436	0
017	10	11	IT	0	0	40,00%	1.312.436	0

◊ *Come RP-MS61.*

2.4.18 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  1 MAR 17    MS67      1 MAR 17  19:32:27 Page
GCM     :  GKK
Aderente:  GKK
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.*

2.4.19 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|    ,00|         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.

2.4.20 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".

2.4.21 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.

2.4.22 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  GKKIntraday 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     GKKXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX          - 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 iPartecipante 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 CC&G 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 CC&G effettua l'addebito.

2.4.23 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 CC&G richieda 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.

2.4.24 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 CC&G 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 Infagiornalieri 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

oppure

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.

2.4.25 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.Ades.   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.Ades.   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 conun 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.Ades.   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.

2.4.26 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 CC&G 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.

2.4.27 RP-MC09 Cash Settlement per inadempimento AGREX

Il tabulato viene prodotto a seguito dell'attivazione di uno o più cash settlement.

Esempio di Tabulato RP-MC09

```
BAN1 BANCA UNO SPA                    Cash Settlement per inadempimento AGREX          RP-MC09    12 NOV 11    21:57:08    PAG. 1
                                      COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
                                                Situazione al: 12 NOV 11
Valuta:  EURO

Conto:  TERZI      Sottoconto:  MRSS    Intestato a: MARIO ROSSI   Cod. Fiscale:  MRRRSSTE78K09G873G    Part. IVA:

POSIZIONI NON IN CONSEGNA

Contratto:   DWHEAT1L  FUTURES SU GRANO DURO      DICEMBRE 2011

                                  - - - Posizioni - - -      Quantità          Intervallo          Cash
Prezzo      Lunghe      Corte      Sottostante      Margine %            Settlement

 150,00        3            0             50                 20,00          4.500,00   DR

Contratto:   DWHEAT2C FUTURES SU GRANO DURO      MARZO 2012

                                  - - - Posizioni - - -      Quantità          Intervallo          Cash
Prezzo      Lunghe      Corte      Sottostante      Margine %        Settlement

                        140,00        0            5             50                 20,00          7.000,00   DR

                                          Totale cash settlement posizioni non in consegna:       11.500,00  DR

POSIZIONI IN CONSEGNA

Contratto:   DWHEAT1K  FUTURES SU GRANO DURO      NOVEMBRE 2011

Abbinamento num. :  1111110008              Data di regolamento, entro il:     30 NOV 11
Posticipo termini di consegna (Y/N):  N     Data di regolamento posticipata al:

Ammontare A:                      - - - Posizioni - - -      Quantità          Intervallo          Cash
Prezzo      Lunghe      Corte      Sottostante      Margine %        Settlement

 104,00       0            6             50                 25,00           7.800,00   DR

Ammontare B:                      - - - Posizioni - - -      Quantità                              Cash
Prezzo      Lunghe      Corte      Sottostante                         Settlement

                         8,00        0            8             50                                3.200,00   DR

                                                Cash settlement posizioni in consegna:          7.800,00   DR

                                                                                   TOTALE:     19.300,00  DR
```

◊ Il tabulato viene prodotto per il Partecipante inadempiente e per il/i Partecipante/i ad esso abbinato/i ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ Nella sezione "**POSIZIONI NON IN CONSEGNA**" sono indicati gli eventuali cash settlement effettuati da CC&G per il regolamento delle posizioni non in consegna.

◊ Nella sezione "**POSIZIONI IN CONSEGNA**" sono indicati gli eventuali cash settlement effettuati da CC&G per il regolamento delle posizioni in consegna.

◊ Il segno sarà "**DR**" (debito) per il Partecipante inadempiente e "**CR**" (credito) per il/i relativi Partecipante/i abbinato/i.

◊ L'importo complessivo del cash settlement a credito/debito da regolare per il Partecipante è indicato nell'ultima riga alla voce "**TOTALE**".

2.4.28 RP-MSG1 Margini Iniziali su posizioni in consegna abbinate

Il tabulato indica il calcolo dei Margini Iniziali sulle posizioni in consegna abbinate.

Esempio di Tabulato RP-MSG1

```
Ader.:BAN1 BANCA UNO SPA          Margini Iniziali su posizioni in consegna abbinate      RP-MSG1   31 AUG 12 20:19:49   PAGE    1
Valuta:   EUR - EURO                       COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

Conto:   TERZI   *OMN  Gruppo Mercati:AGRX           Contrattazioni Del: 31 AUG 12

Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle        Margini        Margini
                             Ammont.ITM        Cop./Str.        Ordin.    Premio/MTM      Consegna    Addizionali         Totali
F DWHMAD2H                       114,00                          400C                          0,00

DWHEAT DELIVERY                                                                10.000,00          00,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                     10.000,00          00,00     114.500,00     124.500,00

Totale Conto:  TERZI   EUR - EURO             Valuta:         1,00000000                                                   124.500,00

Ader.:BAN1 BANCA UNO SPA          Margini Iniziali su posizioni in consegna abbinate      RP-MSG1   31 AUG 12 20:19:49   PAGE    2
Valuta:   EUR - EURO                       COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

Conto:   PROPRIO *OMN  Gruppo Mercati:AGRX           Contrattazioni Del: 31 AUG 12

Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle        Margini        Margini
                             Ammont.ITM        Cop./Str.        Ordin.    Premio/MTM      Consegna    Addizionali         Totali
F DWHMAW2H                       114,00                          400L                          0,00

DWHEAT DELIVERY                                                                     00,00          00,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                         00,00          00,00     114.500,00     114.500,00

Totale Conto:  PROPRIO EUR - EURO             Valuta:         1,00000000                                                   114.500,00
```

◊ La colonna "**Descrizione Contratto**" indica il simbolo del contratto e la relativa scadenza.

◊ La colonna "**Prezzo**" indica il prezzo di regolamento giornaliero.

◊ La colonna "**Nette/Ordin**" indica il numero delle posizioni corte (C) o lunghe (L).

◊ La colonna "**Margini Addizionali**" indica l'importo dei Margini Iniziali sulle posizioni in consegna abbinate. Per ulteriori dettagli relativi alla modalità di determinazione di tale importo si rimanda al "Manuale MMeG Marginazione Mercato Grano" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

◊ La colonna "**Margini su Premio/MTM**" indica l'importo degli eventuali Margini di Mark to Market. Per ulteriori dettagli relativi alla modalità di determinazione di tale importo si rimanda al "Manuale MMeG Marginazione Mercato Grano" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

◊ La colonna "**Margini Totali**" riporta l'ammontare complessivo dei Margini Iniziali calcolato come somma algebrica tra i "Margini su Premio/MTM" e i "Margini Addizionali".

2.4.29 RP-MSG2 Margini Iniziali Ordinari AGREX

Il tabulato indica il calcolo dei Margini Iniziali ordinari effettuato da CC&G sulle posizioni Futures AGREX.

Esempio di Tabulato RP-MSG2

```
Ader.: BAN2  BANCA DUE SPA                        Margini Iniziali Ordinari AGREX    RP-MSG2   27 AUG 12 19:08:55   PAGE    1
Valuta:   EUR - EURO                             COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

Conto:   TERZI   *OMN  Gruppo Mercati: AGRX           Contrattazioni Del: 27 AUG 12

Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle        Margini        Margini
                             Ammont.ITM        Cop./Str.        Ordin.    Premio/MTM      Consegna    Addizionali         Totali
F DWHEAT2I                       117,00                          10L                           0,00
F DWHEAT2L                       134,00                          10L                           0,00

DWHEAT DELIVERY                                                                   0,00           0,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                        0,00           0,00       6.300,00       6.300,00

Totale Conto:  TERZI   EUR - EURO             Valuta:         1,00000000                                                  6.300,00

-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
-

Ader.:BAN2  BANCA DUE SPA                         Margini Iniziali Ordinari AGREX    RP-MSG2   27 AUG 12 19:08:55   PAGE    2
Valuta:   EUR - EURO                             COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE

Conto:   PROPRIO *OMN  Gruppo Mercati: AGRX           Contrattazioni Del: 27 AUG 12

Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle        Margini        Margini
                             Ammont.ITM        Cop./Str.        Ordin.    Premio/MTM      Consegna    Addizionali         Totali
F DWHEAT2I                       117,00                          50C                           0,00
F DWHEAT2L                       134,00                          50C                           0,00

DWHEAT DELIVERY                                                                   0,00           0,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                        0,00           0,00      31.500,00      31.500,00

Totale Conto:  PROPRIO EUR - EURO             Valuta:         1,00000000                                                 31.500,00
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ La colonna "**Descrizione Contratto**" indica il simbolo del contratto e la relativa scadenza.

◊ La colonna "**Prezzo**" indica il prezzo di regolamento giornaliero.

◊ La colonna "**Nette/Ordin**" indica il numero delle posizioni corte (C) o lunghe (L).

◊ La colonna "**Margini Addizionali**" indica l'importo dei Margini Iniziali ordinari. Per ulteriori dettagli relativi alla modalità di determinazione di tale importo si rimanda al "Manuale MMeG Marginazione Mercato Grano" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

◊ La colonna "**Margini Totali**" riporta l'ammontare complessivo dei Margini Iniziali pari ai "Margini Addizionali".

2.4.30 RP-MSG4 Margini Iniziali su Consegna e Maggiorati AGREX

Il tabulato indica il calcolo dei Margini Iniziali su Consegna e Maggiorati.

Esempio di Tabulato RP-MSG4

```
Ader.: BAN2 BANCA DUE SPA            Margini Iniziali su Consegna e Maggiorati AGREX     RP-MSG4   24 AUG 12 18:50:39   PAGE    1
                                         COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Valuta:   EUR - EURO

Conto:   TERZI   *OMN  Gruppo Mercati: AGRX          Contrattazioni Del: 24 AUG 12

Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle        Margini        Margini
                             Ammont.ITM        Cop./Str.        Ordin.    Premio/MTM      Consegna    Addizionali         Totali
F DWHINC2H                       114,00                          280C                          0,00

DWHEAT DELIVERY                                                                   0,00           0,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                        0,00           0,00     961.800,00     961.800,00

Totale Conto:  TERZI   EUR - EURO            Valuta:         1,00000000                                                 961.800,00

-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
-
Ader.: BAN2 BANCA DUE SPA            Margini Iniziali su Consegna e Maggiorati AGREX     RP-MSG4   24 AUG 12 18:50:39   PAGE    2
                                         COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
Valuta:   EUR - EURO

Conto:   PROPRIO *OMN  Gruppo Mercati: AGRX          Contrattazioni Del: 24 AUG 12

Descrizione Contratto          Prezzo/          Posiz.          Nette/    Margini su      Straddle        Margini        Margini
                             Ammont.ITM        Cop./Str.        Ordin.    Premio/MTM      Consegna    Addizionali         Totali
F DWHDLV2H                       114,00                          300L                          0,00

DWHEAT DELIVERY                                                                   0,00           0,00           0,00

Grp.Prod.  Offset              Mrg.Minimo:                                        0,00           0,00     687.000,00     687.000,00

Totale Conto:  PROPRIO EUR - EURO            Valuta:         1,00000000                                                 687.000,00
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ La colonna "**Descrizione Contratto**" indica il simbolo del contratto e la relativa scadenza.

◊ La colonna "**Prezzo**" indica il prezzo di regolamento giornaliero.

◊ La colonna "**Nette/Ordin**" indica il numero delle posizioni corte (C) o lunghe (L).

◊ La colonna "**Margini Addizionali**" indica l'importo dei Margini Iniziali su Consegna. Per ulteriori dettagli relativi alla modalità di determinazione di tale importo si rimanda al "Manuale MMeG Marginazione Mercato Grano" disponibile sul sito web di CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

◊ La colonna "**Margini Totali**" riporta l'ammontare complessivo dei Margini Iniziali pari ai "Margini Addizionali".

2.4.31 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 precedente    Variazione

0001 GKK 65.051.819,77   4.592.850,10    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               ,00

TOTAL:   65.514.881,25                   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 CC&G).

2.4.32 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.

2.4.33 RP-MMDF Variazione Default Fund Comparti Azionario e Derivati Azionari

Il tabulato è utilizzato da CC&G 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 www.lseg.com/ccg 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.

2.4.34 RP-MMMT Variazione Default Fund Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD

Il tabulato è utilizzato da CC&G 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

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:

- 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 www.lseg.com/ccg 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.

2.4.35 RP-MMEL Variazione Default Fund Comparto Derivati dell'Energia

Il tabulato è utilizzato da CC&G per comunicare le variazioni del Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia.

Esempio di Tabulato RP-MMEL

```
Ader.: BAUN BANCA UNO SPA                          VARIAZIONE DEFAULT FUND            RP-MMEL     16 FEB 18   13:06:09 Pag. 1
Valuta: EUR - EURO


Default Fund Comparto/i:                              Derivati dell'Energia

Data variazione e regolamento Quote di Contribuzione: 19/02/2018

Causale di pagamento:                                 BOR-MEL

Variazione ammontare Default Fund:                    NO [1]     Da Euro:                A Euro:

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 www.lseg.com/ccg 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.

2.4.36 RP-MMAG Variazione Default Fund Comparto Derivati su Commodities Agricole

Il tabulato è utilizzato da CC&G per comunicare le variazioni del Default Fund relativo al Comparto Derivati su Commodities Agricole.

Esempio di Tabulato RP-MMAG

```
Ader.: BAUN BANCA UNO SPA                          VARIAZIONE DEFAULT FUND            RP-MMAG     16 FEB 18   13:06:09 Pag. 1
Valuta: EUR - EURO


Default Fund Comparto/i:                              Derivati su Commodities Agricole

Data variazione e regolamento Quote di Contribuzione: 19/02/2018

Causale di pagamento:                                 BOR-MAG

Variazione ammontare Default Fund:                    NO [1]     Da Euro:              A Euro:

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 www.lseg.com/ccg 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.

2.5 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: xxxxxxxxxxx                  Interessi Mensili Maturati            RP-MS05      9 DEC 14  17:11:51 Pag.    1
                                 CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto:   PROPRIO                   Periodo  dal 01 NOV 14 al 30 NOV 14
                                    Accumulati     Tasso    Interessi     Tasso    Interessi     Tasso    Interessi
 Data                Saldo           Interessi
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: BAN1 BANCA UNO SPA                    Commissioni giornaliere di rettifica        RP-MF40     6 NOV 18  21:41:04  Pag.   1
                                               CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
                                                  Operazioni del 06 NOV 18

Valuta     : EUR - EURO
Conto      : Terzi
Sottoconto : *OMN
                                 O/C disponibile       Rettifiche posizioni       Tipo       Orario                Commissione
Tipo  Serie                    Tot.Open   Tot.Close   Diminuzione    Aumento   Commissione  Operazione                  Euro
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
---

 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            6          0        W       12:00:08                    0,00
 F    FIB8L                    0           0            2          0        W       12:15:02                    0,50
 F    FIB8L                          0           0            3          0        W       17:00:05                    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

   Totale MEMBER:           2.040,00                228,00            2.268,00

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

   Totale MEMBER:             400,00                   ,00              400,00

   Totale C/TERZI:            400,00                   ,00              400,00
   Totale C/PROPRIO:        2.040,00                228,00            2.268,00
   Totale GCM:              2.440,00                228,00            2.668,00
```

◊ 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

(Report MS42 – marginazione separata e Report MS24 – Marginazione separata dei Sottoconti) 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 (Report MS42 – marginazione separata tra Comparti e Report MS24 – Marginazione separata dei Sottoconti) 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
                                       CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto:   PROPRIO *OMN                                Da: 01 JAN 03  A: 31 JAN 03
         ---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
                                     Commissioni     Commissioni     Commissioni   Comm.Ritardo       Commissioni       Importo
                                      Clearing      Dispositive   Set/Esercizio   Depos. Titoli         diverse
                                    -------------  -------------  -------------  -------------     -------------    -------------
02 JAN 03  AZA07  V                        0,18           ,00            ,00                                              0,18
           ENI    C                       60,00           ,00            ,00                                             60,00
           SPMIB  F                      120,38         54,00            ,00                                            174,38
           SPMIB  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*Totale:
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 (Report MS42 – marginazione separata tra Comparti e Report MS24 – marginazione separata dei sottoconti) 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 Riferim	ID CC&G	Simbolo	Titolo	ISIN	Data Regolam	Data 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	4DDLM7	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	LTT	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 CC&G" 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

```
Mbr: 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        CCT       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        CCT       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        CCT       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
_____________________________________________________________________________________________________________________

                                            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

```
Mbr: GKK                                  Commissioni Obbligazionario Wholesale     RP-MFM6     06 JAN 14  10:29:04   Pag:1
                                            CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto: PROPRIO                                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        CCT        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        CCT        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        CCT        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 Mor: XXXX  XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX                iCSD - Retail Commissioni Mensili      RP-MFM8     06 JAN 14  10:21:36   Pag:1
                                                CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto: TERZI                                      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 XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX iCSD - Commissioni Giornaliere RP-MFM9 06 JAN 14 10:21:35 Pag: 1
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
Conto: TERZI 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
20140102ABNGGB01	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; *CC&G* 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 *CC&G* propone di esercitare automaticamente;

◊ la colonna "**Esercizio Non Automatico**" indica le opzioni At-the-Money o Out-of-the-Money che *CC&G* 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 *CC&G* 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 *CC&G* in esercizio automatico o abbandono di opzioni In-the-Money proposte da *CC&G* 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

```
Mbr:  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            Gia
Titolo Da Consegnare        Simbolo        Consegnare          Ritirare            Controvalore   Liquid.      Consegnati
Conto:  TERZI
  STTT PAGINE GIALLE         SPG              5.000 A                                 10.250,00CR 18JAN01          2.500
  STTT PAGINE GIALLE         SPG                                 7.500 A            15.000,00DR 19JAN01
  STTT 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
                                            Da                  Da                                Data              Gia
Titolo Da Consegnare          Simbolo     Consegnare          Ritirare            Controvalore  Liquid.     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, CC&G 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, CC&G 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: MOTI
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 CR
```

◊ 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, CC&G 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, CC&G 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      Data    Cto   Posizioni                          Prezzo          Controvalore    Credito/Debito
          Liquid.  Scad.Fail   L/C   Quantità       Controvalore       Riferimento        Corrente          Teorico    MKT
TIM     13 JAN 04 22 JAN 04  T  C          9            39,60CR        4,65300000          41,87            2,27      MTA
TIT     13 JAN 04 22 JAN 04  T  C          5            10,00CR        2,61800000          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            35,42CR        5,13400000          35,93             ,51      MTA
EDN     15 JAN 04 26 JAN 04  T  C         13            19,89CR        1,53900000          20,00             ,11      MTA
F       15 JAN 04 26 JAN 04  T  C         11            62,15CR        6,23600000          68,59            6,44      MTA
G       15 JAN 04 26 JAN 04  T  C         11           234,90CR       21,60000000         237,60            2,70      MTA
LUX     15 JAN 04 26 JAN 04  T  C         22           304,92CR       13,19000000         290,18           14,74CR    MTA
NTV     15 JAN 04 26 JAN 04  T  C         19           258,97CR       14,80300000         281,25           22,28      MTA
TIT     15 JAN 04 26 JAN 04  T  L         20            50,80          2,61800000          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
Controvalore
                             Isin         Liquid    Scad.Fail pe ct  C
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)      RP-MP14      3 MAY 12  21:15:03 Pag.
                                          CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
                                          Posizioni in Fail al:' 3 MAY 12
Simbolo   Data      Data    Cto     Posizioni                          Prezzo          Controvalore     Credito/Debito
          Liquid.  Scad.Fail   L/C  Quantità       Controvalore       Riferimento          Corrente          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-MS27 Margini Posizioni Fail - Comparti Azionario e Derivati Azionari

Il tabulato riporta i margini applicati sulle posizioni in fail relative ai Comparti Azionario e Derivati Azionari.

Esempio di Tabulato RP-MS27

```
Ader.:GKK                    Margini Posizioni Fail Comparti Azionario e Derivati   RP-MS27   16 JAN 04 10:46:05   PAGE 1

Valuta:   EURO                                  CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Conto:   TERZI        Gruppo Mercati:NET          Contrattazioni Del: 15 JAN 04

Descrizione Contratto        Prezzo/                      Nette/    Margini                    Margini       Margini

                            Ammont.ITM                    Ordin.      MTM                   Addizionali        Totali

C AL         16 JAN 2004                                  44.500C     9.195,50

ALLEANZA ASS       .                                                 9.195,50                       0,00

Grp.Prod.  Offset            Mrg.Minimo:                            9.195,50                  26.955,21     36.150,71

Totale Conto:  TERZI   EURO                 Valuta:       1,00000000                                        36.150,71
```

◊ 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 "**Descrizione Contratto**" indica il simbolo della Classe oggetto di fail, la relativa descrizione e la data di regolamento entro la quale le posizioni dovevano essere regolate per non andare in fail;

◊ la colonna "**Nette/Ordin**." Indica il numero di posizioni oggetto di fail con l'indicazione del tipo, C (corte) o L (Lunghe);

◊ la colonna "**Margini MTM**" indica i margini Mark to Market;

◊ la colonna "**Margini Addizionali**" indica i margini addizionali calcolati per il gruppo di prodotti o di classi;

◊ la colonna "**Margini Totali**" indica il totale dei margini calcolati per ciascun gruppo di classi / prodotti;

◊ la colonna "**Totale Conto**" indica il totale dei margini complessivamente calcolati sulle posizioni in fail registrate su ogni singolo conto (Proprio e Terzi).

2.8.8 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 RRG-REL	Num. gg/fail	Classe	Posizione Lunga	Posizione Corta	Interv. Margine	Margine non rettificato	% Modul	Margine Ordinario	Margine Mark-to-Market
02L3BA	2	02	0	3.968.520	0,35	16.668			1.525,17-
0LIAXW	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 CC&G (**www.ccg.it**) alla sezione **Risk Management>Metodologie**.

2.8.9 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
TOTALE	EURO					8.327,60

◊ 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.

2.8.10 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     XXXXXXXXXXXXXXXXX
 Aderente:  XXXX     XXXXXXXXXXXXXXXXX
 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.

2.8.11 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     XXXXXXXXXXXXXXXXX

Member  :  XXXX     XXXXXXXXXXXXXXXXX

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.

2.8.12 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     XXXXXXXXXXXXXXXXX
Aderente:   XXXX     XXXXXXXXXXXXXXXXX
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.

2.8.13 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 forzosa delle stesse mediante esecuzione del Buy-In secondo quanto previsto dalle Istruzioni.

Conto: TERZI

ID Netta	ID DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	Data regolamento	Scadenza fail	Titoli da 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, CC&G 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.

2.8.14 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 forzosa 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, CC&G 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.

2.8.15 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                          RP-ME03  16 FEB 04  21:04:46
Pag.
                                        (Comparti Azionario e Derivati Azionari)
                                        CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
                                        Attivazione sell-Out dal 17 FEB 04

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 FB 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, CC&G 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.

2.8.16 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 forzosa 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
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 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, CC&G 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.

2.8.17 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 stato attivata l'esecuzione del Buy-In per le sotto indicate posizioni in fail:

Conto: TERZI

ID CCG Netta	ID CCG DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	Data regolamento	Scadenza fail	Titoli da 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 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 CC&G, 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 stato 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	EINGAW	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 CC&G;

◊ 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.

2.8.18 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.

2.8.19 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                    RP-ME07  17 FEB 04  10:04:46
Pag. 1
                                        (Comparti Azionario e Derivati Azionari)
                                      CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA
                                        Esecuzione Sell-Out del 17 FEB 04

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                                          Data          Scadenza   Titoli da
Netta     DVP      Titolo     Simbolo   ISIN          regolamento   fail       ritirare     Controvalore
I114EW    9HLTL9   Mediaset     MS      IT0001063210  16 FEB 04     25 FB 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.

2.8.20 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.

2.8.21 RP-ME09 Esito Buy-In/partecipante 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 CC&G.

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

                      Data       Data       Titoli da      Controvalore   Titoli       Titoli       Titoli       Titoli
Simb     ISIN         regolamento esecuzione acquistare     originario     acquistati   acquistati   ancora da    sottoposti a
                                  buy-in     originariamente               nei giorni   oggi         acquistare   cash settlement
                                                                           precedenti
MS       IT0001063210 16 FEB 04  25 FB 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 acqusitati 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 CC&G o che la CC&G trattiene a titolo di commissioni.

2.8.22 RP-ME10 Esito Buy-In/partecipante 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 CC&G e il Partecipante in bonis inseriti nella liquidazione netta.

Esempio di Tabulato RP-ME10

```
Ader: GKK                          Esito  esecuzione  Buy-In /partecipante in bonis          RP-ME10  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:  FWT3AD     ID DVP:  1KH1PL

                      Data        Data        Titoli da       Controvalore  Titoli        Titoli     Titoli     Titoli
Simb      ISIN        regolamento esecuzione  acquistare      originario    acquistati    acquistati ancora da  sottoposti a
                                  buy-in      originariamente               nei giorni    oggi       acquistare cash
settlement                                                                  precedenti
MS        IT0001063210 16 FEB 04  25 FEB 04   1.000           8.400,00 CR   0             700        300        0


Compensi inseriti

                                  Data        Data        Data fine     Titoli da
Titolo    Simbolo   ISIN          eseguito    regolamento validità      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 acquisitati dal Buy-In Agent e per i quali si procede con il cash settlement;

◊ la sezione "**compensi inseriti "** indica i compensi CC&G/Partecipante in bonis che vengono inseriti a seguito degli acquisti effettuati dal Buy-In Agent.

2.8.23 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 CC&G addebiterà in Target2.

2.8.24 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)

2.8.25 RP-ME13 Cash settlement/partecipante 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

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

Determinazione del cash settlement:

          Ammontare A
   Prezzo riferimento        Nr. titoli        Controvalore       Percentuale        Ammontare A
          giorno esecuzione
                   9,00      300               2.700,00            10%               270,00 €

          Ammontare B
          Ultimo prezzo          Nr. titoli     Controvalore       Controvalore       Ammontare B
          riferimento                                             originario
          8,90                     300           2.670,00           2520,00           150,00 €

          òCash settlement =  270,00 € DR

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

ID Netta:  FW3BD2     ID DVP:  1KH7GK

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

Determinazione del cash settlement:

          Ammontare A
          Prezzo riferimento  Nr. titoli        Controvalore       Percentuale        Ammontare A
          giorno esecuzione
              13,10            1000              13.100,00            10%              1310,00 €

          Ammontare B
          Ultimo prezzo          Nr. titoli     Controvalore       Controvalore       Ammontare B
          riferimento                                             originario
         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 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 acquisitati 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.

2.8.26 RP-ME14 Cash settlement/partecipante 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:  1KH1PL

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

Determinazione del cash settlement:

          Ammontare A
   Prezzo riferimento          Nr. titoli          Controvalore          Percentuale          Ammontare A
    giorno esecuzione
    9,00                          300                2.700,00               10%                270,00 €

          Ammontare B
          Ultimo prezzo          Nr. Titoli         Controvalore          Controvalore          Ammontare B
          riferimento                                                     originario
          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

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

Determinazione del cash settlement:

        Ammontare A
        Prezzo riferimento      Nr. titoli          Controvalore          Percentuale          Ammontare A
        giorno esecuzione
            13,10                 1000               13.100,00              10%                 1310,00 €

          Ammontare B
        Ultimo prezzo           Nr. titoli          Controvalore          Controvalore          Ammontare B
        riferimento                                                       originario
        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 acquisitati 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.

2.8.27 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 CC&G addebiterà in Target2.

2.8.28 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 CC&G addebiterà in Target2.

2.8.29 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 forzosa nonché il differenziale che il partecipante in fail deve corrispondere a CC&G.

Esempio di Tabulato RP-ME17

```
Ader: GKK                    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

          Data            Data          Titoli da   Controvalore      Titoli        Titoli      Titoli      Titoli        Titoli
Simbolo   ISIN            regolamento   esecuzione  vendere           originario    venduti     venduti     ancora da     soggetti a
                                        sell-out    originariamente                 nei giorni  oggi        vendere       restituzione
                                                                                                precedenti
MS        IT0001063210    16 FEB 04     17 FB 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                      5.000,00 CR
                                        differenziale                                     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 forzosa mediante incasso del controvalore da parte di CC&G 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 CC&G o che la CC&G trattiene a titolo di commissioni.

2.8.30 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 CC&G addebiterà in Target2.

2.8.31 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

```
Gcm:  BKG                          Compensazione dei fails in esecuzione di Buy-In          RP-ME20  18 OTT 10  20:49:51 Pag. 1
Ader: GKK                            (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      ID CCG       Descrizione    ISIN                Data mancato        Data                Titoli originari        Controvalore
 Netta       DVP                                            regolamento         fine validità       da ritirare             Originario

0PXNOG        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     ID CCG         Descrizione     ISIN                Data mancato        Data                Titoli originari            Controvalore
 Netta      DVP                                              regolamento         fine validità       da consegnare               Originari

PA11RO    XN143D     ETF IEAISH   IE00B3DKX041               8 OTT 10            19 OTT 10            4.400                      44.400,00
CR

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
Compensazione delle istruzioni:

          Descrizione      ISIN                Data esecuzione                    Quantità titoli             Controvalori
                                               Compensazione                   compensata                   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      Data          Quantità titoli                Controvalori
                                                                   Compensazione    fine validità                residui  Titoli residui

            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 CC&G;

◊ la colonna "**ID CCG DVP**" indica l'istruzione lorda di CC&G

◊ 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*).

2.8.32 RP-ME21 Compensazione dei fails in esecuzione di Buy-In – Comparto Obbligazionario

Analogo a report ME20

2.8.33 RP-ME25 Esecuzione Buy-In/Parzializzazione – Comparto Azionaro 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 CC&G 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 CCG: EK8WT1     Id.DVP CCG: 9SJA1G

                Data      Data        Titoli da      Controvalore    Titoli         Titoli      Titoli      Titoli
Simb  ISIN      regolame. esecuzione  acquistare     originario      acquistati     acquistati  ancora da   sottoposti a
                          buy-in  originariamente                nei giorni     oggi        acquistare  cash settlement
                                                                   precedenti
QFI ITO003242598 26 GEN 10  04 FEB 10      18,00          2.839,86 DR      0,00         10,00       8,00        0,00
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
Compensi inseriti nel ciclo netto notturno:

                          Data        Data          Data fine        Titoli da        Controvalore
            ISIN          eseguito    regolamento   validità         ritirare
            ITO003242598  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 CC&G/Partecipante in bonis che vengono inseriti a seguito di consegne parziali.

2.8.34 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)

2.8.35 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
0GTXY9	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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.36 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 RP-ME41 7 JUN 17
11:47:39 Page 1

(Comparti Obbligazionario e Obligazionario ICSD)
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	Stato
AGKLZS	20170522AGKLZS01	BELGIUM TF 4% MZ32	BE0000326356	24 MAY 17	14 JUN 17	1.000,00	1.409,73	MALIS
AGKL0B	20170522AGKL0B01	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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.37 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          RP-ME42 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 a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare

Conto: Terzi
                                                   Data       Nuova        Posizioni
XTRN   ID            Titolo              ISIN      Regolamen  Fine Val     In fail      Controvalore  Member  C/H  Stato
GTSOS  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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.38 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          RP-ME43 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 a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare
Conto: Terzi
                                                          Data       Nuova        Posizioni
XTRN    ID              Titolo              ISIN          Regolamen  Fine Val     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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.39 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
0GTCFX	1705230571624447	SOGEFI	IT0000076536	01 JUN 17	07 JUN 17	1.531,00	2.532,27	BONIS
0GUP5N	1705230571626260	POLIGRAFICI EDIT	IT0000086923	01 JUN 17	07 JUN 17	0,00	0,65	BONIS
0GUKLN	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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.40 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 Obligazionario 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

				Data		Posizioni		
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Regolamen	Fine Val	In fail	Controvalore	Stato
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
AGKPQB	20170524AGKPQB01	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
AGKPWB	20170524AGKPWB01	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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.41 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

```
COM: GKK                                Istruzioni In Esecuzione di Buy In Partecipante Generale          RP-ME46 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
Conto: Terzi
                                                          Data                  Posizioni
XTRN   ID              Titolo          ISIN          Regolamen   Fine Val    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
OGUAQL 1705230571625801 TERNA          IT0003242622  01 JUN 17   07 JUN 17     10,00             50,30   BBBB    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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.42 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 Obligazionario 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          RP-ME47 7 JUN 17 11:47:39 Page 1
                                        (Comparti Obbligazionario e Obligazionario 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: Terzi
                                                        Data       Nuova        Posizioni
XTRN    ID              Titolo              ISIN        Regolamen  Fine Val     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
DDJIFT  20170407DDJIFT01  BUND LUG39 EUR 4,   DE0001135325  24 MAY 17  07 JUN 17    7.000,00     7.777,25      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 Obligazionario 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 forzosa;**

◊ **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 CC&G "Malis" ovvero in ritiro da CC&G "Bonis".

2.8.43 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: EU000A1G0AB4                                 EFSF LG21 EUR 3,375
TRN ORIGINALE: 2012072000ABCN01                   Data            Scadenza        Titoli da        Titoli da
                                          Tipo    regolamento     fail consegnare ricevere         Controvalore Val
                      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: DE000A0GTCB9                                 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 CC&G 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

2.8.44 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: Sottoconti

2.9.1 RP-MC05 Sottoconti AGREX

Il tabulato riporta le informazioni relative ai sottoconti del Partecipante.

Esempio di Tabulato RP-MC05

```
Mbr:  BAN1   BANCA UNO SPA                Sottoconti AGREX              RP-MC05       12 NOV 11    21:57:08     PAG.  1
                                        COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE
                                       Situazione al: 12 NOV 11
Conto:  TERZI

Sottoconto      Intestato a          Codice Fiscale               Partita IVA

SUB1            MARIO ROSSI          MRRSS77P08H5023F
SUB2            UGO BIANCHI                                       85487731954
SUB3            GIANNINI SIM                                      77458798712
SUB4            ALDO BASSI           LDDBSS57F07T682S
SUB5            MARCO NERI           MRCNNR89G09G690F
SUB6            BIANCHI SIM                                        45678979878

Conto:  PROPRIO

Sottoconto      Intestato a           Codice Fiscale               Partita IVA

AAA1            FILIALE MI
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Derivati su Commodities Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ Alla voce "**Conto**:" viene indicato il conto (Proprio o Terzi) relativo ai sottoconti sotto indicati.

◊ La colonna "**Sottoconto**" indica il codice del sottoconto.

◊ La colonna "**Intestato a**" indica il cliente (conto Terzi) o l'unità operativa (conto Proprio) a cui è intestato il sottoconto.

◊ Le colonne "**Codice Fiscale"** e **"Partita IVA**", indicano rispettivamente il codice fiscale o la partita IVA del cliente a cui è intestato il sottoconto.

2.10 Sezione X: Basilea III – Asset Class

2.10.1 RP-MB01 AGREX asset class

Il tabulato riporta le informazioni relative ai sottoconti del Partecipante.

Esempio di Tabulato RP-MB01

Basilea III - AGRX asset class RP-MB01 4 NOV 14 14:45:05

Page 1
Mbr: XXXXXXXXXX

Update at: 31 OCT 14

Agricultural Derivatives asset class

Ref:	Basel Parameter	Description	Value
01	KCCP	Hypothetical capital of the CCP	0
02	DFCM	Sum of clearing members' pre-funded default fund contributions	663.000
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	3.537
04	N	Total number of clearing members	3
05	Beta	Concentration factor	1
06	DFcCM	Sum of clearing members' contractually committed default fund contributions	663.000
07	Initial margin	Total amount of initial margin	689.640,74

- ◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Derivati su Commodity Agricole ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.
- ◊ Alla voce "**KCCP**:" viene indicato il capitale teorico della CCP.
- ◊ Alla voce "**DFCP**:" viene indicata la somma dei contributi prefinanziati versati dai Partecipanti come quota di contribuzione al default fund.
- ◊ Alla voce "**DFCCP**:" viene indicato l'ammontare totale delle risorse finanziarie stanziate dalla CCP ("Skin In the Game")
- ◊ Alla voce "**N**:" viene indicato il numero totale dei Partecipanti.
- ◊ Alla voce "**Beta**:" viene indicato il fattore di concentrazione.
- ◊ Alla voce "**DFcCM**:" viene indicato la somma dei contributi non prefinanziati che potrebbero essere richiesti ai Partecipanti come quota di contribuzione al default fund
- ◊ Alla voce "**Initial Margin**:" viene indicata la somma totale degli Initial Margin.

2.10.2 RP-MB02 Equity Derivates asset class

Il tabulato riporta le informazioni relative ai sottoconti del Partecipante.

Esempio di Tabulato RP-MB02

Basilea III - Equity Deriv. asset class RP-MB02 4 NOV 14 14:45:05

Page 1
Mbr: XXXXXXXX

Update at: 31 OCT 14

Equity Derivatives asset class

Ref:	Basel Parameter	Description	Value
01	KCCP	Hypothetical capital of the CCP	160.755
02	DFCM	Sum of clearing members' pre-funded default fund contributions	1.401.643.000
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	7.477.867
04	N	Total number of clearing members	46
05	Beta	Concentration factor	0,291
06	DFcCM	Sum of clearing members' contractually committed default fund contributions	1.401.643.000
07	Initial Margin	Total amount of initial margin	2.102.560.445,98

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Derivati su Equity ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ La descrizione delle voci dei campi è analoga a quella riportata nel paragrafo RP-MB01 AGREX asset class.

2.10.3 RP-MB03 IDEX asset class

Il tabulato riporta le informazioni relative ai sottoconti del Partecipante.

Esempio di Tabulato RP-MB03

Basilea III - IDEX asset class RP-MB03 4 NOV 14 14:45:05

Page 1
Mbr: xxxxxxxx

Update at: 31 OCT 14

Energy Derivatives asset class

Ref:	Basel Parameter	Description	Value
01	KCCP	Hypothetical capital of the CCP	0
02	DFCM	Sum of clearing members' pre-funded default fund contributions	20.745.000
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	110.676
04	N	Total number of clearing members	9
05	Beta	Concentration factor	0,847
06	DFcCM	Sum of clearing members' contractually committed default fund contributions	20.745.000
07	Initial Margin	Total amount of initial margin	49.672.013,42

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Derivati su Energy ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ La descrizione delle voci dei campi è analoga a quella riportata nel paragrafo RP-MB01 AGREX asset class.

2.10.4 RP-MB04 BOND asset class

Il tabulato riporta le informazioni relative ai sottoconti del Partecipante.

Esempio di Tabulato RP-MB04

```
                                        Basilea III - BOND asset class            RP-MB04      4 NOV 14  14:45:05
Page    1
Mbr:   XXXXXXX
                                                        Update at: 31 OCT 14
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                        Repo and Reverse Repo Transactions asset class                                           |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|Ref: |  Basel Parameter | Description                                     |                     Value           |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|     |                  |                                                 |                                     |
|  01 |  KCCP            |  Hypothetical capital of the CCP                |                 109.134             |
|     |                  |                                                 |                                     |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|     |                  |                                                 |                                     |
|  02 |  DFCM            |  Sum of clearing members' pre-funded default fund |           1.884.042.900             |
|     |                  |   contributions                                 |                                     |
|     |                  |                                                 |                                     |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|     |                  |                                                 |                                     |
|  03 |  DFCCP           |  Total amount of the CCP's own pre-funded financial |             10.091.147              |
|     |                  |   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 |                                     |
|     |                  |                                                 |                                     |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|     |                  |                                                 |                                     |
|  04 |  N               |  Total number of clearing members               |                      53             |
|     |                  |                                                 |                                     |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|     |                  |                                                 |                                     |
|  05 |  Beta            |  Concentration factor                           |                      0,4244         |
|     |                  |                                                 |                                     |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|     |                  |                                                 |                                     |
|  06 |  DFcCM           |  Sum of clearing members' contractually committed |           1.884.042.900             |
|     |                  |   default fund contributions                    |                                     |
|     |                  |                                                 |                                     |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
|     |                  |                                                 |                                     |
|  07 |  Initial Margin  |  Total amount of initial margin                 |           7.318.296.120,3           |
|     |                  |                                                 |                                     |
|-----|------------------|-------------------------------------------------|-------------------------------------|
```

◊ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Repo ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni della giornata successiva a quella a cui si riferisce.

◊ La descrizione delle voci dei campi è analoga a quella riportata nel paragrafo RP-MB01 AGREX 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
- ◊ CCSD (Coupon Compensation Settlement Date): Giorno in cui si effettua la compensazione
- ◊ 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. Settlem. 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

```
Mbr: 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
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
 Mbr  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	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	20170330BGJEC0P1	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

```
Mbr: 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

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
  Mbr  Isin          Trn              CVD Date   ASD Date          Definitive Amount   Total Amount      Payment Executed
AKK XS0211034466 20131031AAAPTS01 16/10/2018 31/10/2013                93,83 C
AKK XS0211034466 20131031AAAPSB01 16/10/2018 31/10/2013                93,83 D
AKK 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

```
Dlvy: AKK                                   Payments Balances Coupon Compensation        RP-MS41     26 OCT 18  19:30:06 Page    1
Mbr : GKK                                     CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia
                                                   Payment Date: 26/10/2018
Account :   xxxxx
Currency:   EUR -EURO
Causal  :   CA      CORPORATE ACTION

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
 Mbr  Isin          Trn              CVD Date   ASD Date          Definitive Amount   Total Amount      Payment Executed
AKK XS0211034466 20131031AAAPTS01 16/10/2018 31/10/2013                93,83 C
AKK XS0211034466 20131031AAAPSB01 16/10/2018 31/10/2013                93,83 D
AKK 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-MAG1 Estratto Conto – DF Agrex - Commodit. Agricole

Il tabulato riporta le informazioni relative all'estratto conto per il Comparto Derivati su Commodities Agricole.

Esempio di Tabulato RP-MAG1

```
CC&G                                    Estratto Conto          RP-MAG1    6 OCT 14   18:32:38       pag.1
                                   DF Agrex  - Commodit. Agricole
                    CASSA DI          da data :  1/10/2014   a data :  7/10/2014
                    COMPENSAZIONE
                    E GARANZIA S.p.A.            00000 BANCA xxxx
                                                 Via Nome, 00
                                                 0000      ROMA
PROVVISORIA
                                                                    VALUTA IN EURO
    D A T A    D A T A                                          ------------------------------------
     MOV.TO     VALUTA   DESCRIZIONE CAUSALE                     IMPORTO DARE          IMPORTO AVERE
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------
  1/10/2014              RIPORTO                                     0,00              50.000,00
  6/10/2014   1/10/2014  INTERESSI ATTIVI                            0,00                   1,22-
  6/10/2014   1/10/2014  MAG - SPESE INVIO ESTRAT.CONTO              2,50                   0,00
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------
    SALDO CONTABILE                                                   0,00              49.996,28
                                                              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-MAG2 Estratto Conto Scalare – DF Agrex - Commodit. Agricole

Il tabulato riporta le informazioni di dettaglio relative all'estratto conto scalare per il Comparto Derivati su Commodities Agricole.

Esempio di Tabulato RP-MAG2

```
CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MMT2    6 OCT 14   18:04:35   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

                                  ------------------------------------
  D A T A                              SALDI PER VALUTA EURO
   VALUTA                          D A R E            A V E R E    GIORNI          NR.DEBITORI          NR.CREDITORI
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
 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


CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MAG2    6 OCT 14   18:07:01   Pag.  1
                                        DF MAG    - Merc.Int.Collater.
                      CASSA DI            da data :  1/07/2014   a data : 30/09/2014
                      COMPENSAZIONE
                      E GARANZIA S.p.A.              00000 BANCA
CONTEGGIO DELLE COMPETENZE
INTERESSI
  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-

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
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.

2.12.3 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

```
CC&G                                    Estratto Conto          RP-MDF1    6 OCT 14   18:27:58        pag.1
                                      DF Equity - BIT E DERIVATI
                    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                                                 ----------------------------------
     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  RESTITUZ. 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
                                                                   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-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

```
CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MDF2    6 OCT 14   18:00:25   Pag.  1
                                         DF Equity - Bit e Derivati
                      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
                                  ----------------------------------
   D A T A                              SALDI PER VALUTA EURO
    VALUTA                         D A R E            A V E R E    GIORNI          NR.DEBITORI          NR.CREDITORI
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
 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


CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MDF2    6 OCT 14   18:00:25   Pag.  1
                                         DF Equity - BIT E DERIVATI
                      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
CONTEGGIO DELLE COMPETENZE
INTERESSI
   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-

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
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.

2.12.5 RP-MEL1 Estratto Conto – DF Idex - Mercato Elettrico

Il tabulato riporta le informazioni relative all'estratto conto per il Comparto Derivati dell'Energia.

Esempio di Tabulato RP-MEL1

```
CC&G                                          Estratto Conto              RP-MEL1    6 OCT 14   18:28:13      pag.1
                                            DF Idex   - Mercato Elettrico
                      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                                                        ----------------------------------
     MOV.TO     VALUTA   DESCRIZIONE CAUSALE                                   IMPORTO DARE          IMPORTO AVERE
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
   1/07/2014             RIPORTO                                                      0,00           1.039.000,00
   4/07/2014   1/07/2014  INTERESSI ATTIVI                                            0,00                 955,03
   4/07/2014   1/07/2014  SPESE INVIO ES. CONTO     IDEX                              2,50                   0,00
   7/07/2014   7/07/2014  RESTITUZ. CONT.IN ECCESSO                                 952,53                   0,00
  24/07/2014  24/07/2014  UT.ECC.COP.MAR.F.DO       IDEX                              0,00              50.000,00
   4/09/2014   4/09/2014  SVIN.CONT.DIM. MARG. LIQUIDAT.                          212.000,00                   0,00
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
     SALDO CONTABILE                                                                  0,00             877.000,00
                                                                          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.

2.12.6 RP-MEL2 Estratto Conto Scalare – DF Idex - Mercato Elettrico

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

Esempio di Tabulato RP-MEL2

```
CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MEL2    6 OCT 14   18:04:35   Pag.  1
                                        DF Idex   - Mercato Elettrico
                      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

                                  ------------------------------------
  D A T A                              SALDI PER VALUTA EURO
   VALUTA                          D A R E            A V E R E    GIORNI          NR.DEBITORI          NR.CREDITORI
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
 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


CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MEL2    6 OCT 14   18:07:01   Pag.  1
                                        DF MEL    - Merc.Int.Collater.
                      CASSA DI            da data :  1/07/2014   a data : 30/09/2014
                      COMPENSAZIONE
                      E GARANZIA S.p.A.              00000 BANCA
CONTEGGIO DELLE COMPETENZE
INTERESSI
  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-

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
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.

2.12.7 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 COMPENSAZIONE E GARANZIA S.p.A.

da data : 1/07/2014 a data : 30/09/2014

00000 BANCA xxxx
Via Nome, 00
0000 ROMA

DEFINITIVA

DATA MOV.TO	DATA VALUTA	DESCRIZIONE CAUSALE	VALUTA IN EURO IMPORTO DARE	VALUTA IN EURO IMPORTO AVERE
1/07/2014		RIPORTO	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.

2.12.8 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

```
CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MMT2    6 OCT 14   18:04:35   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

                                  ------------------------------------
  D A T A                              SALDI PER VALUTA EURO
   VALUTA                          D A R E            A V E R E    GIORNI          NR.DEBITORI          NR.CREDITORI
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
 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


CC&G                                        Estratto Conto Scalare          RP-MMT2    6 OCT 14   18:07:01   Pag.  1
                                        DF MMT    - Merc.Int.Collater.
                      CASSA DI            da data :  1/07/2014   a data : 30/09/2014
                      COMPENSAZIONE
                      E GARANZIA S.p.A.              00000 BANCA
CONTEGGIO DELLE COMPETENZE
INTERESSI
  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-

-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------
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 *CC&G* rende disponibili in formato elaborabile ai Partecipanti e agli Agenti di Regolamento nonché i sistemi per il tramite dei quali sono resi disponibili: server FTP, Sistema di Negoziazione del Mercato IDEM e Rete Nazionale Interbancaria

3.1 Sezione I: Server FTP

Sul server FTP di CC&G, **ftp.ccg.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 FTP 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 FTP di CC&G, **ftp.ccg.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 CC&G. 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 CC&G" 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 FTP 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; *CC&G* 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 *CC&G, in particolare sono disponibili:*

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 CC&G 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 CC&G 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 contente 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[1]
Applicazione bancaria destinataria: FFFFF[2]CG011YY[1]
Categoria applicativa: CG01

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

[1] YY = 00 (Produzione), YY = PR (Prova).
[2] FFFFF = Codice Ente.

Descrizione Tracciato Record Messaggio M01

IDC 01 - TIPO MESSAGGIO
Assume il valore "M01"
IDC 040 – MITTENTE
Contiene il codice Ente "90000" di CC&G. 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

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

Adeguamento mensile dei margini

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

Contribuzioni

X21	Non attiva
X22	Non attiva
X23	Non attiva

400 → 499: Margini infragiornalieri

Causale	**Descrizione sintetica**

(Margini Aggiuntivi Infragiornalieri)

413	Richiesta Margini Aggiuntivi Infragiornalieri Conto Proprio
414	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 CC&G. 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 *CC&G*; 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 *CC&G* (90000).

IDC 050-DESTINATARIO

Codice ENTE del destinatario.

IDC 020-C.R.0.

E' il codice di riferimento del messaggio inviato dalla *CC&G*. 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

MEL = Quota di contribuzione al Default Fund per il Comparto Derivati dell'Energia

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 *CC&G* 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 CC&G. 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:I298XXXXXXXXXXXX}
{3:{108:0089430070190000}}
{**4**: :20:0089430070190000 :12:003
:77E:CCG - Notice of N. 2 deb/cred payments on 2008-09-23
P01-L19999900000DENOMINAZIONE SOCIALE 000000007201875**D**EUR
P01-L2MIFADG20080923PA10222590000P/VARIE/MIF-ADG-99999-P-}
P02-L19999900000DENOMINAZIONE SOCIALE 000000486507677**C**EUR
P02-L2MIFADG20080923PA10222590000T/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; **MEL** = Default Fund per il Comparto Derivati dell'Energia; **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; **IEL** = Interessi sui depositi effettuati per il Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia; **RES** = Restituzione Default Fund a seguito di recesso dal Sistema.

- 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 CC&G (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 solo 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 CC&G 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

CCG-operations@euronext.com
+39 06 32395 321
+39 06 32395 303

Disclaimer

La presente pubblicazione ha finalità esclusivamente informative e non è da intendersi in alcun modo come sollecitazione all'investimento. Questa pubblicazione viene fornita nello stato in cui si trovano ("as is") senza rappresentazioni o garanzie di alcun tipo. Sebbene sia stata adoperata tutta la diligenza necessaria al fine di assicurare l'esattezza del contenuto, CC&G non ne garantisce l'accuratezza, né la completezza. CC&G non potrà essere ritenuta responsabile per eventuali perdite o danni di qualsiasi natura derivanti dall'utilizzo di tali informazioni, dalla fiducia accordata a quanto contenuto in questa pubblicazione o da condotte fondate su tale pubblicazione o sul contenuto della medesima. Nessuna informazione contenuta o citata nella presente pubblicazione costituisce o potrà costituire il fondamento di un contratto. I diritti e obblighi connessi ai servizi erogati da CC&G dipenderanno esclusivamente dalle regole stabilite dalla Società. Tutti i diritti di proprietà e tutti gli interessi relativi o connessi a questa pubblicazione spettano ad CC&G. Sono espressamente vietate, in qualsiasi forma, le attività di ridistribuzione e di riproduzione di questa pubblicazione senza la previa autorizzazione scritta di CC&G. CC&G declina ogni obbligo di aggiornamento delle informazioni contenute in tale pubblicazione. L'uso non autorizzato dei marchi e diritti di proprietà intellettuale di pertinenza di CC&G e delle altre Società appartenenti al Gruppo Euronext è strettamente proibito e potrebbe violare la tutela legale sui marchi, sul copyright e/o altre leggi applicabili

© 2021, CC&G - Tutti i diritti riservati

CC&G

A EURONEXT COMPANY

www.ccg.it