

# MANUALE TECNICO

Versione 2.1

GIUGNO 2021



**CC&G**

A EURONEXT COMPANY

# INDICE

<b>1. PREMESSA .....</b>	<b>9</b>
<b>2. PARTE I TABULATI DI CLEARING .....</b>	<b>11</b>
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 rettificare .....	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 classi	93
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 Esercite/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 Obbligazionario	162
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 Azionario 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 - Commodity Agricole .....	208
2.12.2	RP-MAG2 Estratto Conto Scalare – DF Agrex - Commodity 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
<b>3.</b>	<b>PARTE II DATI IN FORMATO ELABORABILE .....</b>	<b>216</b>
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
<b>4.</b>	<b>PARTE III INFRASTRUTTURA TECNOLOGICA .....</b>	<b>229</b>
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		Acquisto/	Contratti	Eseguiti	Commissioni	Numero di
	Consegna	Prezzo	Vendita	Negoziati	Partecipante	di Clearing	Riferimento
Conto:	TERZI	*QMN					
SPG	O MAR01 2,50 C	0,1200	A	8		,80	116431
	MAR01 2,50 C	0,1200	V	2	CCFF	,20	116556

- ◇ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- ◇ la colonna **"Acquisto/Vendita"** è valorizzata con la lettera "A" in caso di acquisto, con "V" in caso di vendita;
- ◇ i contratti ricevuti in Give-Up (presenti nel tabulato RP-MT15) sono corredati dall'indicazione del Partecipante negoziatore nella colonna **"Eseguiti Partecipante"**;
- ◇ la colonna **"Commissioni di Clearing"** evidenzia, per ogni contratto, le relative commissioni dovute 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							
				-----Valore Di Esercizio-----		Data di		Prezzo di	
	Serie	Conto	Esercitate	Assegnate	Debito	Credito	Liquid.	Liquid.	Tipo di
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/XXXXXXXXXX			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 *QMN									
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
SEPMIB	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		Acquisto/		Contratti		Eseguiti		Commissioni	
		Consegna		Prezzo		Vendita		Negozianti		Partecipante	
										di Clearing	
										Numero di	
										Riferimento	
Conto : TERZI *QMN											
ENI	O	MAR01	6,40	P	0,1780	A	600	YYYY	60,00	104959	
		MAR01	6,40	P	0,1780	V	600	YYYY	60,00	104959	
		MAR01	6,40	P	0,1785	A	400	YXX	40,00	104962	
		MAR01	6,40	P	0,1785	V	400	YXX	40,00	104962	
OIB30	O	JAN01	45500	C	30	A	10	YYCC	4,10	113819	
		JAN01	45500	C	34	A	5	YYCC	2,05	114169	
		JAN01	45500	C	34	A	1	WRR	,41	114228	
		JAN01	45500	C	34	A	1	WRR	,41	114232	
		JAN01	45500	C	34	A	1	WRR	,41	114291	
		JAN01	45500	C	35	A	2	WRR	,82	114322	
		JAN01	45500	C	30	A	10	WRR	4,10	114454	
		JAN01	45500	C	33	A	100	WRR	41,00	114512	

- ◇ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti del Comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- ◇ la colonna "**Acquisto/Vendita**" è valorizzata con la lettera "A" in caso di acquisto, con "V" in caso di vendita;
- ◇ la colonna "**Eseguiti Partecipante**" indica il Partecipante che ha eseguito i contratti ricevuti in Give-Up;
- ◇ la colonna "**Commissioni di Clearing**" evidenzia, per ogni contratto, le relative commissioni dovute a 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	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento
Consegna							
Conto : TERZI *OMN							
MIB30 F	MAR01	43450	V	2		,52	100010
	MAR01	43410	A	1		,26	100073
	MAR01	43040	V	1	YYYY	,26	105727
	MAR01	43040	V	1		,26	105731
	MAR01	42800	A	1		,26	108781
	MAR01	42800	A	1	XXXX	,26	108782
	MAR01	42700	A	2	YYYY	,52	113880

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

## 2.1.8 RP-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 *QMN		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 ATTUALE			24				10.490,00 DR		
Totale Margini di Variazione EU							10.095,00 DR		

- ◇ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti al comparto Derivati Azionari ed è disponibile prima dell'avvio delle negoziazioni;
- ◇ le posizioni contrattuali trasferite vengono evidenziate con la dizione: **"TRANSFER"** se relative a trasferimento manuale; **"TRF POS"** se relative a trasferimenti effettuati con BCS;
- ◇ i contratti trasferiti mediante BCS, ad eccezione di quelli trasferiti in regime di give up Internazionale sono 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 *QMN			Contrattazioni del: 21 DEC 07						
Serie	Precedente Posiz. Aperte		Acquisti		Prezzo		Margine di Variazione	Num. di Rif	
	Attivita'	Corte	Lunghe	Mkt O/C	Vendite	Prec/Contr Chiusura			
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	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Partecipante di Clearing	Numero di Riferimento
Consegna						
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	Prezzo	Acquisto/ Vendita	Contratti Negoziati	Eseguiti Partecipante	Commissioni di Clearing	Numero di Riferimento
Consegna							
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	SEMIB SP05	22097		AKDESK
D	C	11:40	Y		111308	27/07/05	33.740,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	22605		AKDESK
D	C	11:42	Y		111289	27/07/05	33.740,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03069		AKDESK
D	C	11:42	Y		111252	27/07/05	33.745,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03069	1AANLP	AKDESK
D	C	11:43	N		100245	27/07/05	33.745,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03015		AKDESK
R	C	12:18		O	109313	27/07/05	33.775,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03131		U35F
R	C	12:18		O	109314	27/07/05	33.775,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03131		U35F
R	C	13:57		O	106499	26/07/05	33.690,0000	1	P	0000	F	SEMIB SP05	03249	1AANLP	IT
D	C	17:02	Y		121131	21/07/05	,9495	25	P	0000	O	ENI DC05	23 C 03104	LTOPDE	LTOPDE

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



- ◇ La colonna "**O/F**" è valorizzata con "**O**" se il trasferimento si riferisce ad opzioni; con "**F**" se riguarda futures;
- ◇ Nella colonna "**Cnt.**" viene indicato il codice 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
0001	BAN1		PROPRIO		*OMN	-3	BAN1
	SUB1						TERZI
0001	BAN1		TERZI	SUB1		-3	BAN1
	*OMN						PROPRIO
0002	BAN1		TERZI	SUB2		-1	BAN8
	*OMN						PROPRIO
0003	BAN1		TERZI	SUB2		-5	BAN6
	SUB3						TERZI
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
Acct: TERZI *OMN		COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE				
		Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12				
Codice Isin	Contratto	Precedente Attivita'	Posizioni Lunghe	Posizioni 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
Acct: TERZI SUB1		COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE				
		Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12				
Codice Isin	Contratto	Precedente Attivita'	Posizioni Lunghe	Posizioni 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
Acct: TERZI SUB2		COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE				
		Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12				
Codice Isin	Contratto	Precedente Attivita'	Posizioni Lunghe	Posizioni 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
Acct: PROPRIO *OMN		COMPARTO DERIVATI SU COMMODITIES AGRICOLE				
		Posizioni Nette Iniziali al: 24 AUG 12				
Codice Isin	Contratto	Precedente Attivita'	Posizioni Lunghe	Posizioni 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](http://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								
GARANZIA							CASSA DI COMPENSAZIONE E	
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						
OCT 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						
OCT 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	
OCT 01/01/97-04	IT0000367885	15 JAN 03	12 DEC 02	T P C	100.000.000	100.422.855,59CR	186.250,00CR	
OCT 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	
OCT 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	Data	Cto	Posizioni	Prezzo	Controvalore	Controvalore	Credito/Debito		
	Liquidaz.	Negoziatz.	L/C	Quantit..	Riferimento	Corrente	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	Status	Posizioni	Quantità	Prezzo di	Controvalore	Tipo	Controvalore	
Consegna	Consegna	in Ritiro	(Ton)	Regolamento	Consegna fisica	Regolam.	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		
IVA:				Cod. Fiscale: MRRRSSTE78K09G873G		
				Part.		
Abbinamento num. : 1111110001		Data di regolamento, entro il:		30 NOV 11		
FERRO				Luogo di regolamento: SILOS		
		Posticipo termini di consegna (Y/N): N		Data di regolamento posticipata al:		
Posizioni in	Posizioni	Quantità	Prezzo di	Controvalore	Tipo	Controvalore
Consegna	in Ritiro	(Ton)	Regolamento	Consegna fisica	Regolam.	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 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 del Limite Paese (Tot. Val. Garanzia dopo LP) - e il valore di garanzia effettivamente utilizzato - tenuto conto del Limite Totale (Garanzie Collaterali utilizzate dopo LT);
- ◇ il campo "**Totale Eccesso Paese (LP)**" contiene la somma delle garanzie in eccesso di tutti i Paesi (somma degli "Eccesso Paese");
- ◇ Il campo "**Cash Call**" rappresenta l'ammontare dei Margini Addizionali Intraday non coperto da titoli e da versare in cash.

## 2.4 Sezione IV: Regolamento Margini e Default Fund

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



### 2.4.1 RP-MS52 Avviso di Addebito/Accredito

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

#### Esempio di Tabulato RP-MS52

Ader.:BANU BANCA UNO SPA			Avviso di Addebito/Accredito		RP- MS52	1 MAR 16	7:30:35 Page	1
Banca:BANU BANCA UNO SPA			Contrattazioni Del: 29 FEB 16					
Valuta: EUR - EURO								
Ai sensi dell'Articolo B.5.1.1 del Regolamento, si richiede di rendere capiente il Conto PM nel Sistema Target2 sul quale sarà effettuato da CC&G l'addebito diretto degli importi di seguito indicati:								
Aderente	Conto	T.Adese.	Ragione Sociale	Codice	Causale	Ammontare		
BANU/5099		Diretto	BANCA UNO SPA	05099	BOR MDF	150.128,10		
BAND/5033	PROPRIO	Diretto	BANCA DUE SPA	05033	MIF ADG	40.150,22		
ABAB/6888	PROPRIO	Segregato	ABAB CONTO ISA	16888	MIF ADG	72.930,09		
						-----		
Totale						263.208,41		
L'addebito inizierà alle ore 9.00 e terminerà alle ore 9.30 del: 2 MAR 16								
-----								
Ader.:BANU BANCA UNO SPA			Avviso di Addebito/Accredito		RP- MS52	1 MAR 16	7:30:35 Page	2
Banca:BANU BANCA UNO SPA			Contrattazioni Del: 29 FEB 16					
Valuta: EUR - EURO								
Si informa che stiamo accreditando sul Vostro Conto PM i seguenti importi per conto di:								
Aderente	Conto	T.Adese.	Ragione Sociale	Codice	Causale	Ammontare		
BANU/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 accreditati 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 Partecipante Diretto, o "Segregato" se il pagamento è riferito ad un conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) di un Partecipante Diretto;
- ◇ Alla voce **Ragione Sociale** è indicata la denominazione sociale del Partecipante o del conto segregato;
- ◇ Alla voce **Codice** è indicato il codice Ente del Partecipante o del conto segregato;
- ◇ Alla voce **Causale** è indicata la causale di pagamento; le possibili causali sono le seguenti:
  - **MIF ADG** = regolamento giornaliero dei margini;
  - **MIF RES** = restituzione di contante in eccesso attivata in via permanente;
  - **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 Obblazionario 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 Obblazionario 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.Ad.	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.Ad.	Ragione Sociale	Codice	Causale	Ammontare			
BANU	PROPRIO	Diretto	BANCA UNO SPA	05099	MIF RES	10.160.187,00			
ABAB	TERZI	Segregato	ABAB CONTO ISA	16888	MIF ADG	14.855.545,30			
						-----			
Totale						25.015.732,30			

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

- ◇ Alla voce **T.Adess** è indicato "Diretto" se il pagamento è riferito al Partecipante Diretto, o "Segregato" se il pagamento è riferito ad un conto segregato (ISA, AOA, GOSA o NOSA) dello stesso;
- ◇ Alla voce **Ragione Sociale** è indicata la denominazione sociale del Partecipante Diretto o del conto segregato;
- ◇ Alla voce **Codice** è indicato il codice Ente del Partecipante o del conto segregato;
- ◇ Alla voce **Causale** è indicata la causale di pagamento; le possibili causali sono le seguenti:
  - **MIF ADG** = regolamento giornaliero dei margini;
  - **MIF RES** = restituzione di contante in eccesso attivata in via permanente;
  - **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 Obblazionario 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 Obblazionario 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.
XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX	CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		
Valuta: EUR - EURO	Contrattazioni del: 7 FEB 14		
	Conto Proprio	Conto Terzi	
Margini Iniziali	89.000,00	,00	
Garanzie Collaterali Disponibili	,00	,00	
	-----	-----	
Integrazione Margini Iniziali	89.000,00	,00	
Garanzie Collaterali in Eccesso	,00	,00	
Contante presso Cassa	500,00	,00	
Margini Iniziali Scoperti	88.500,00	,00	
Contante Residuo	,00	,00	
Competenze			
Margini di Variazione sui Futures	,00	,00	
Margini di Variazione sulle Options	,00	,00	
Premi Options	,00	,00	
Pagamento E/A	,00	,00	
Trasferim.Contante/Buy-in/Penali	,00	,00	
Commissioni	,00	,00	
Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento	,00	,00	
Adesione/Servizi Clearing/Buy-In	,00	,00	
Interessi	,00	,00	
Competenze Nette	,00	,00	
	-----	-----	
Contante in Eccesso	,00	,00	
	-----	-----	
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 XXXXXXXXXXXXXXXX	Dettaglio Posizione Finanziaria MOA	RP-MS12	9 FEB 14	22:08:54	Pag.	1
	CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
Valuta: EUR - EURO	Contrattazioni del: 7 FEB 14					
	Conto Proprio	Conto Terzi				
Margini Iniziali	4.859.212,00	,00				
Competenze						
Margini di Variazione sui Futures	,00	,00				
Margini di Variazione sulle Options	,00	,00				
Premi Options	,00	,00				
Pagamento E/A	,00	,00				
Trasferim.Contante/Buy-in/Penali	,00	,00				
Commissioni	,00	,00				
Comm.Dep.Titoli/Rit.Pagamento	,00	,00				
Adesione/Servizi Clearing/Buy-In	,00	,00				
Interessi	,00	,00				
Competenze Nette	,00	,00				

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

## 2.4.6 RP-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 *QMN		Gruppo Mercati:MTA		Contrattazioni Del: 15 JUL 05				
Descrizione Contratto		Prezzo/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MIM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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](http://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 iniziali calcolati separatamente per Comparto			RP-MS42	2 APR 03 13:27:33	PAGE	1
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Conto: PROPRIO *QMN		Gruppo Mercati:MTA			Contrattazioni Del: 18 JUL 05			
Descrizione Contratto		Prezzo/ Ammont.TTM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MIM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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 FUT	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.:xxxxxxxxxxxxxxxxxxxxxx		Settlement separato			RP-MS42	2 APR 03 13:27:33	PAGE	2
Valuta: EURO		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA						
Conto: PROPRIO *QMN		Gruppo Mercati:MTA			Contrattazioni Del: 18 JUL 05			
Descrizione Contratto		Prezzo/ Ammont.TTM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MIM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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](http://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 Iniziali 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/ Ammont. ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini Totali		
F M01FB FB 08 FUTURE EL MESE 1	39,73		2L		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 FUTURE EL MESE 2	67,12		2L		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 FUTURE EL TRIMESTRE 1	65,87		3L		0,00 0,00	0,00			
F Q02FB SP 08 FUTURE EL TRIMESTRE 2	66,98		3L		0,00 0,00	0,00			
F Q03FB DC 08 FUTURE EL TRIMESTRE 3	58,24		3L		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](http://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			



### 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
GARANZIA				CASSA DI COMPENSAZIONE E			
Valuta: EURO							
Conto: TERZI *OMN Gruppo Mercati:IDEX				Contrattazioni Del: 3 JAN 08			
Descrizione Contratto	Prezzo/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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](http://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			
	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](http://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. Oblig. posizioni marginabili AL 1 MAR 17 MS61 1 MAR 17 19:32:09 Page									
POSIZIONI SELEZIONATE											
GCM	:	GKK									
Aderente:	:	GKK									
Conto	:	F	Sottoconto:								
Valuta	:	EUR									
ISIN	Tipo	L/S	Numero	Data	Data	Quantità	Controvalore	Repo	Tasso	Group	Grou
			Contratto	Contratto	Regolam.				Repo	Regol	Coll
ES00000121S7	OBE	L	0000000071	22 FEB 17	02 MAR 17	5.000.000	5.133.918,00	T	0,9000	BOND	A
ES00000128C6	OBE	L	0000000090	01 MAR 17	02 MAR 17	7.000.000	7.127.075,90	T	0,7000	BOND	A
IT0003644769	BTP	L	0000000039	27 FEB 17	02 MAR 17	2.000.000	1.986.961,40	T	0,5100	BOND	A
IT0004532559	BTP	L	0000000041	27 OCT 16	31 OCT 17	1.000.000	995.987,30	T	0,0200	BOND	A

◇ il tabulato viene prodotto per i Partecipanti al Comparto Obbligazionario e Obbligazionario ICSD che abbiano scelto 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](http://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: COG		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							
		ABBATTIMENTO INTRA CLASSE							
Classe	Posizione	Posizione	Percent.	Importo	Posizione Lunga	Posizione Corta			
	Lunga	Corta	Riduzio.	Riduzione	Ridotta	Ridotta			
ES 01	0,00	0,00	5,00%	0,00	0	0			
ES 02	0,00	0,00	20,00%	0,00	0	0			
ES 03	0,00	0,00	50,00%	0,00	0	0			
ES 04	0,00	0,00	80,00%	0,00	0	0			
ES 05	0,00	0,00	65,00%	0,00	0	0			
ES 06	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
ES 07	0,00	0,00	75,00%	0,00	0	0			
ES 08	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
ES 09	0,00	0,00	75,00%	0,00	0	0			
ES 10	0,00	0,00	70,00%	0,00	0	0			
ES 11	14.847.576,90	0,00	55,00%	0,00	14.847.577	0			
ES 12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0	0			
Ader		M.I. Comp. Obbl. abbatt. intra classe		AL	1 MAR 17	MS64	1 MAR 17	19:32:25	Page
GCM	: GKK								
Aderente:	GKK								
Conto	: F	Sottoconto:							
Valuta	: EUR								
Paese	: IT	ITALY							
		ABBATTIMENTO INTRA CLASSE							
Classe	Posizione	Posizione	Percent.	Importo	Posizione Lunga	Posizione Corta			
	Lunga	Corta	Riduzio.	Riduzione	Ridotta	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									
ABBATTIMENTO INTER CLASSE											
Classe A					Classe B						
Priorità	Classe			Posizione	Posizione	Percentuale	Posizione	Posizione			
	A — B			Lunga	Corta	Riduzione	Lunga	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									
ABBATTIMENTO INTER CLASSE											
Classe A					Classe B						
Priorità	Classe			Posizione	Posizione	Percentuale	Posizione	Posizione			
	A — B			Lunga	Corta	Riduzione	Lunga	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

◇ 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**

1 MAR 17 19:32:28 Page

Calcolo dei Margini Iniziali MTS

AL 1 MAR 17

MS70

GCM : GKK

Aderente: GKK

Conto : F      Sottoconto:

MARGINE FINALE

			Margini di				EUR
DIV		Margini	Mark to		Margini	Cambio	HAIRCUT
		Ordinari	Market		Iniziali		
EUR		3.766.874	3.163.147C		603.727	1,000000	,00
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*

10:21:54 Page 1		Riepilogo Margini Iniziali	RP-MS00	8 SEP 08
Ader: GKK		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA		
Valuta : EURO		Trade Date: 29 JAN 12		
Comparti - Margini Report		Conto Proprio	Conto Terzi	
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 infragiornerli;
- ◇ 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 GKKXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX - Conto PROPRIO
Ammontare: Euro 16.598.095,00 Ora Rilevazione: 13:05:55
Causale del Versamento: MIF-INF-99999-P

Si segnala che in caso di mancato pagamento entro il termine fissato nella
presente richiesta, il Partecipante sarà dichiarato inadempiente ai sensi
dell'articolo B.6.1.1 del Regolamento.
```

- ◇ il tabulato viene prodotto per 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 Infragiornalieri richiesti.

### Esempio di Tabulato RP-MS32

Firm: 9999	Intraday Margin Call	RP-MS32	2 NOV 17	17:11:58	Page 1
URGENTE--RICHIESTA MARGINI AGGIUNTIVI INFRAGIORNALIERI					
Si fa seguito alla richiesta di margini aggiuntivi infragiornalieri avanzata con il report MS31 per comunicare che gli strumenti finanziari depositati: sono sufficienti a coprire i margini aggiuntivi infragiornalieri.					
Partecipante: 9999 BNKA SPA Conto: PROPRIO					
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					
Prezzo	Lunghe	Corte	--- Posizioni --- Sottostante	Quantità Margine %	Intervallo Settlement	Cash			
150,00	3	0	50	20,00	4.500,00	DR			
Contratto: DWHEAT2C FUTURES SU GRANO DURO				MARZO 2012					
Prezzo	Lunghe	Corte	--- Posizioni --- Sottostante	Quantità Margine %	Intervallo Settlement	Cash			
		140,00	0	5	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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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](http://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](http://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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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](http://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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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/ Ammont.ITM	Posiz. Cop./Str.	Nette/ Ordin.	Margini su Premio/MTM	Straddle Consegna	Margini Addizionali	Margini 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](http://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 Valuta: EUR - EURO	VARIAZIONE DEFAULT FUND	RP-MMDF	16 FEB 18	13:06:09 Pag. 1
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:				
<ul style="list-style-type: none"><li>- nel menu Default Fund della ICWS e per il tramite del messaggio M01 sulla RNI sarà segnalata la variazione delle Quote di Contribuzione;</li><li>- i Partecipanti debitori o i relativi Agenti di Regolamento dovranno rendere capiente il proprio Conto PM nel Sistema TARGET2 affinché CC&amp;G possa provvedere all'addebito diretto delle somme dovute [2] (il periodo di addebito inizierà alle ore 9:00 e terminerà alle ore 9:30 [3]);</li><li>- CC&amp;G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento [2].</li></ul>				
Note:				
<p>[1] Sul sito Internet di CC&amp;G <a href="http://www.lseg.com/ccg">www.lseg.com/ccg</a> sono disponibili le seguenti informazioni:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- alla sezione "Risk Management - Default Fund Parameters", l'ammontare del Default Fund e gli altri parametri utilizzati per il calcolo delle Quote di Contribuzione;</li><li>- alla sezione "Risk Management", le modalità di calcolo delle Quote di Contribuzione.</li></ul>				
<p>[2] Utilizzando la procedura ancillare n.3 (c.d. Bilateral Settlement).</p>				
<p>[3] Gli importi in addebito saranno notificati da CC&amp;G al Partecipante Diretto o al relativo Agente di Regolamento mediante:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- i Report MS14, MS53 e MS52;</li><li>- il "preavviso di pagamento" inviato nel Sistema TARGET2 via ICM alle ore 7:45;</li><li>- qualora attivata, la "Rendicontazione giornaliera dei pagamenti" (messaggi M03 via RNI e messaggi MT298 via SWIFT).</li></ul>				

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

## 2.4.34 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 Valuta: EUR - EURO	VARIAZIONE DEFAULT FUND	RP-MMMT	16 FEB 18	13:06:09 Pag. 1
Default Fund Comparto/i:	Obbligazionario, Obbligazionario ICSD <span style="background-color: #cccccc; display: inline-block; width: 50px; height: 1em;"></span>			
Data variazione e regolamento Quote di Contribuzione:	19/02/2018			
Causale di pagamento:	BOR-MMT			
Variazione ammontare Default Fund:	SI [1]	Da Euro: 3.800.000.000,00	A Euro: 3.900.000.000,00	
Nella stessa giornata del 19/02/2018:				
<ul style="list-style-type: none"> <li>- nel menu Default Fund della ICWS e per il tramite del messaggio M01 sulla RNI sarà segnalata la variazione delle Quote di Contribuzione;</li> <li>- i Partecipanti debitori o i relativi Agenti di Regolamento dovranno rendere capiente il proprio Conto PM nel Sistema TARGET2 affinché CC&amp;G possa provvedere all'addebito diretto delle somme dovute [2] (il periodo di addebito inizierà alle ore 9:00 e terminerà alle ore 9:30 [3]);</li> <li>- CC&amp;G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento [2].</li> </ul>				
Note:				
<p>[1] Sul sito Internet di CC&amp;G <a href="http://www.lseg.com/ccg">www.lseg.com/ccg</a> sono disponibili le seguenti informazioni:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- alla sezione "Risk Management - Default Fund Parameters", l'ammontare del Default Fund e gli altri parametri utilizzati per il calcolo delle Quote di Contribuzione;</li> <li>- alla sezione "Risk Management", le modalità di calcolo delle Quote di Contribuzione.</li> </ul>				
[2] Utilizzando la procedura ancillare n.3 (c.d. Bilateral Settlement).				
<p>[3] Gli importi in addebito saranno notificati da CC&amp;G al Partecipante Diretto o al relativo Agente di Regolamento mediante:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- i Report MS14, MS53 e MS52;</li> <li>- il "preavviso di pagamento" inviato nel Sistema TARGET2 via ICM alle ore 7:45;</li> <li>- qualora attivata, la "Rendicontazione giornaliera dei pagamenti" (messaggi M03 via RNI e messaggi MT298 via SWIFT).</li> </ul>				

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

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

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

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

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

## 2.5 Sezione V: Interessi e Commissioni

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

### 2.5.1 RP-MS05 Interessi Mensili Maturati

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

#### Esempio di Tabulato RP-MS05

Ader: xxxxxxxxxxxx		Interessi Mensili Maturati		RP-MS05	9 DEC 14	17:11:51	Pag.	1
		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 CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Operazioni del 06 NOV 18				RP-MF40	6 NOV 18	21:41:04	Pag. 1
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	ID				Data	Data				
Riferim	CC&G	Simbolo	Titolo	ISIN	Regolam	Scadenza	Quantita'	Controvalore	Fees	
21 JUN 05	UF35HY	TOD	TOD'S	IT0003007728	21 JUN 05	30 JUN 05	332	13.742,75	50,00	Fail
22 JUN 05	UF35HY	TOD	TOD'S	IT0003007728	21 JUN 05	30 JUN 05	332	13.742,75	50,00	Fail
23 JUN 05	4DDL7	ENI	ENI	IT0003132476	23 JUN 05	04 JUL 05	92.857	1.991.817,50	200,00	Fail
23 JUN 05	4DDJAY	ENI	ENI	IT0003132476	23 JUN 05	04 JUL 05	93.238	1.999.990,08	200,00	Fail
28 JUN 05	9YWW70	LIT	LOTTOMATICA	IT0003380919	28 JUN 05	07 JUL 05	537	14.687,17	50,00	Fail
30 JUN 05	YWGG2U	TOD	TOD'S	IT0003007728	30 JUN 05	11 JUL 05	6.158	243.533,33	150,00	Fail
							Totale	5.450,00		

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

Mor: GKK		Commissioni Obbligazionario Retail		RP-MFM4	06 JAN 14 10:29:56	Pag: 1
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				
Conto: TERZI		Da 01 DEC 13		a 31 DEC 13		
Data	Provenienza	Simbolo	ID Commissione	Importo Commissione	Valuta	
2/12/2013	MOT	BTI	Clearing Fees	3,68	EUR	
2/12/2013	MOT	BTP	Clearing Fees	7,59	EUR	
2/12/2013	MOT	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		
<hr/>						
PROVENIENZA				TOTALI		
PROVENIENZA				TOTALI		
MOT				123,74		
TLX				3,45		
Totale Commissioni:				127,19		

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

◇ la colonna "data" indica la data in cui è stata applicata la commissione;

## 2.5.8 RP-MFM6 Commissioni Obbligazionario Wholesale

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

### Esempio di Tabulato RP-MFM6

Mor: GKK	Commissioni Obbligazionario Wholesale		RP-MFM6	06 JAN 14 10:29:04	Pag:1
	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	OCT	Clearing Fees	6,85	EUR
2/12/2013	PCT	CTZ	Clearing Fees	4,93	EUR
3/12/2013	PCT	BTI	Clearing Fees	12,30	EUR
3/12/2013	PCT	BTP	Clearing Fees	19,22	EUR
3/12/2013	PCT	OCT	Clearing Fees	4,10	EUR
3/12/2013	PCT	CTZ	Clearing Fees	4,91	EUR
4/12/2013	PCT	BTI	Clearing Fees	27,11	EUR
4/12/2013	PCT	BTP	Clearing Fees	608,77	EUR
6/12/2013	PCT	OCT	Clearing Fees	12,33	EUR
15/12/2013	PCT	CTZ	Clearing Fees	162,45	EUR
31/12/2013	MAC	MAC01A	Clearing Fees	678,49	EUR
Tot Conto: PROPRIO				1.391,41	
<hr/>					
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 XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX				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

Mor: XXXX XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX			iCSD - Commissioni Giornaliere		RP-MFM9	06 JAN 14 10:21:35	Pag: 1
			CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				
Conto: TERZI			Data 31 DEC 13				
<hr/>							
20140102AEMMB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEMO9B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEMSWB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEMVCB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEMZFS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM5QN01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM6XS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENMYS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM19B01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM3YB01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM53B01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENCHS01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENJMS01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
Tot Conto: TERZI				16,90			
<hr/>							
1							
Conto: PROPRIO							
<hr/>							
20140102AEMJAS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM5FS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM64B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENAI01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENGGB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENGGS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENHQ01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENHTB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENHZS01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENLRB01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENL9B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENM4B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENM4S01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENP1S01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENP6B01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENQ0S01	NET	MOT	Consegna	1,30	EUR		
20140102AEM7SB01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENEVS01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENE9S01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENF7S01	NET	TLX	Consegna	1,30	EUR		
20140102AENIOS01	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 scade 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 scade 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 *QMN	5	7	36.000,00DR	I	*	
BIP	JA01	8,40 P	TERZI *QMN	7	7	58.800,00DR	I		
BIP	JA01	8,60 P	TERZI *QMN	5	5	43.000,00DR	I		
BRM	JA01	1,20 C	TERZI *QMN	2	2	12.000,00DR	I		
BRM	JA01	1,30 C	TERZI *QMN	3	13	19.500,00DR	I		
ENEL	JA01	4 P	TERZI *QMN	9	9	36.000,00DR	I		
ENEL	JA01	4,20 P	TERZI *QMN	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*

Mor: GKK		Opzioni Esercitate/assegnate da liquidare		RP-MD01	17 JAN 01	20:44:58	Page 1
		CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					
		Alla Data Del: 17 JAN 01					
		Da	Da		Data		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					
Titolo Da Consegnare	Simbolo	Da Consegnare	Da Ritirare	Controvalore	Data Liquid.	Gia Consegnati	
Conto: TERZI							
AAAA ORDINARIE	ENEL	1.900.000 C		13.281.000,00	20JUL05		
Totale Titolo: IT0003128367		1.900.000 Consegna	Controvalore:	13.281.000,00			
BBB ORDINARIE	ENI	5.300.000 C		121.635.000,00	20JUL05		
Totale Titolo: IT0003132476		5.300.000 Consegna	Controvalore:	121.635.000,00			
Totale Controvalore del 20 JUL 05 :				134.916.000,00			

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



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

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

### Esempio di Tabulato RP-MD55

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

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

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

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

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

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

#### Esempio di Tabulato RP-ME30

Ader: GKK				Posizioni in fail marginabil RP-ME30 (Comparto Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Posizioni Iniziali al: 18 FEB 04		17 FEB 04	21:04:46	Pag. 1
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
6BG7HJ	1KH96Z	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	16 FEB 04	23 FEB 04	50.000	Controvalore
							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
TTT	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
NIV	15 JAN 04	26 JAN 04	T C	19	258,97CR	14,80300000	281,25	22,28	MTA
TTT	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 Liquid.	Data Scad.Fail	Cto L/C	Posizioni Quantità	Controvalore	Prezzo Riferimento	Controvalore Corrente	Credito/Debito Teorico	MKT	
Gcm : 00999 PHHHH										
CVAL	02 MAY 12	11 MAY 12	T L	150.000	169.394,59	1,08100000	162.150,00	7.244,59	MTA	
PIA	02 MAY 12	11 MAY 12	T L	150.000	313.982,75	2,27200000	340.800,00	26.817,25CR	MTA	
Saldo liquid.: 02 MAY 12 Conto: TERZI					483.377,34	Conto Liquidazione: 70631				
MOL	03 MAY 12	14 MAY 12	T L	1.329	4.452,15	3,43000000	4.558,47	106,32CR	MTA	
SEML	03 MAY 12	14 MAY 12	T L	650	47.125,00	73,20000000	47.580,00	455,00CR	MTA	
Saldo liquid.: 03 MAY 12 Conto: TERZI					51.577,15	Conto Liquidazione: 70631				

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



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

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

### Esempio di Tabulato RP-MP15

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

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

## 2.8.7 RP-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/ Amont.ITM	Nette/ Ordin.	Margini MTM	Margini Addizionali	Margini 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

GCM : GKK Aderente: GKK Conto: C Sottoconto: Cur: EUR Parametro di maggioraz 10%									
Margini Posizioni Fail Comparto Obbligazionario AL 10 SEP 08 MS97 10 SEP 08 21:08:15 Page 1									
ID	Num.	Classe	Posizione	Posizione	Interv.	Margine non	%	Margine	Margine
RRG-REL	gg/fail		Lunga	Corta	Margine	rettificato	Modul	Ordinario	Mark-to-Market
02L3BA	2	02	0	3.968.520	0,35	16.668			1.525,17-
01IAXW	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](http://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	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX									
Aderente:	:	XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX									
Conto	:	F	Sottoconto:									
Valuta	:	EUR	EUR									
ISIN		Tipo L/S	Identif.Op	Data	Data	Data Fine		Quantità	Controvalore	Group	Gro	
			RRG-REL	RRG-REL	regolam.	validità					coll	
IT0004890882	BTI	S	R320PB	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A		
IT0004890882	BTI	S	R320P9	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A		
IT0004890882	BTI	S	R320PD	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A		
IT0004890882	BTI	S	R320PF	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A		
IT0004890882	BTI	S	R320PJ	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,76	BOND	A		
IT0004890882	BTI	S	R320PH	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	5.000.000,000	5.132.297,72	BOND	A		
XS0953215349	MOT	S	ACPR5S	04 FEB 14	04 FEB 14	18 FEB 14	100.000,000	111.089,73	BOND	A		

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

## 2.8.11 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 XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX							
Member : XXXX XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX							
Account : C Subaccount:							
Currency: EUR EUR							
Margine Mark-to-Market							
ISIN	L/S	Identif.Op	Traded	MTM	Quantity	Revalued	Mark-to-Mark
		RRG-REL	Countervalue	Price	Traded	Countervalue	Marg
IT0004890882	S	R320PB	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320P9	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PD	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PF	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PJ	5.132.297,76	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
IT0004890882	S	R320PH	5.132.297,72	102,291840	5000000,000	5.114.592,00	17.705,7
XS0953215349	S	ACPR5S	111.089,73	109,300000	100000,000	109.300,00	789,7

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

## 2.8.12 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	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX						
Aderente:	XXXX	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX						
Conto	: F	Sottoconto:						
Valuta	: EUR	EUR						
Attribuzione delle Classi								
ISIN	Posizione	Posizione	Rendimento	Duration	Classe			
	Lunga	Corta	Effettivo					
IT0004890882	0,00	30.687.552,00	0,000000	0,0000	01			
XS0953215349	0,00	109.300,00	0,000000	5,6932	33			

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

### 2.8.13 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 forzata delle stesse mediante esecuzione del Buy-In secondo quanto previsto dalle Istruzioni.								
Conto: TERZI								
ID	ID				Data	Scadenza	Titoli da	
Netta	DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	Controvalore
5AU763	1KH6TR	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FB 04	1.000	8.400,00 CR

- ◇ il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari in caso di attivazione del Buy-in, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Buy-in;
- ◇ la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- ◇ la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- ◇ la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- ◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- ◇ la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, 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 (Comparto Obbligazionario) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Attivazione buy-in dal 18 FEB 04			RP-ME02 18 FEB 13 21:04:46 Pag. 1		
Curr: EURO						
Settlement System : 51 ECLR/CEDE						
Si informa che CC&G ha attivato la procedura di Buy-in per le sotto indicate posizioni in fail. Qualora tali posizioni non venissero regolate entro il: 22 Febbraio 13, CC&G provvederà alla chiusura forzata delle stesse mediante l'esecuzione del Buy-In secondo quanto previsto dalle Istruzioni.						
Conto: PROPRIO						
ID	ID			Data	Scadenza	Titoli da
Netta	DVP	Titolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare
E36PUN	1KH064	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	13 FEB 13	22 FB 13	50.000
						Controvalore
						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 forzata 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
IL14EW	9HLTL9	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000	8.400,00 DR

- ◇ il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari in caso di attivazione del Sell-Out, ed è disponibile la mattina del giorno di attivazione del Sell-Out;
- ◇ la colonna "**titolo**" indica lo strumento finanziario cui si riferisce la posizione in fail;
- ◇ la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- ◇ la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";
- ◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata in base allo schema contrattuale;
- ◇ la colonna "**scadenza fail**" indica il termine ultimo entro il quale la posizione in fail può essere regolata. Superato tale termine, 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 1	Sell-out Notice	RP-ME04	16 FEB 04	21:04:46	Pag.		
Comparto Obbligazionario CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA Attivazione sell-out dal 17 FEB 04							
Curr: EURO Settlement System : 51 ECLR/CEDE							
Si informa che la CC&G ha attivato la procedura di Sell-Out per le sotto indicate posizioni in fail. Qualora tali posizioni non venissero regolate entro le: ore 10.00 odierne, CC&G provvederà alla chiusura forzata delle stesse mediante l'esecuzione del Sell-Out secondo quanto previsto dalle Istruzioni							
Conto: PROPRIO							
ID	ID		Data	Scadenza	Titoli da		
Netta	DVP	Titolo	ISIN	regolamento	fail	ritirare	Controvalore
D4RO3P	1KFNEF	BTP 01/05/2009 4,5%	IT0000127336	16 FEB 04	23 FEB 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	ID CCG				Data	Scadenza	Titoli da				
Netta	DVP	Titolo	Simbolo	ISIN	regolamento	fail	consegnare	Controvalore			
5AU763	1KH6TR	Mediaset	MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FB 04	1.000	8.400,00 CR			

- ◇ il tabulato viene prodotto per il Partecipante in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari in caso di 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	ID	Titolo	Simbolo	ISIN	Data di	Data fine	Titoli da	Controvalore
Netta CCG	DVP CCG				Regolamento	validità	consegnare	
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 CR

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	
Netta	DVP	Titolo
D4RO3P	1KFNEF	BTP 01/05/2009 4,5%
	ISIN	
	IT0000127336	
	Data	Scadenza
	regolamento	fail
	16 FEB 04	23 FEB 04
	Titoli da	
	ritirare	
	50.000	
	Controvalore	
	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

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

estremi titoli acquistati oggi:

titolo	Simbolo	ISIN	quantità	controvalore
Mediaset	MS	IT0001063210	400	3.560,00 DR
Mediaset	MS	IT0001063210	300	2.700,00 DR
Totale			700	6.260,00 DR

Differenziale:

MS	IT0001063210	controvalore originario relativo a:	700 titoli: 5.880,00 CR
MS	IT0001063210	controvalore acquisti	6.260,00 DR
Differenziale		380,00 DR (1)	

Se il differenziale è a debito viene visualizzata la seguente voce:

(1) Il differenziale verrà addebitato nel regolamento giornaliero entro di domani

Se il differenziale è a credito viene visualizzata la seguente voce:

(1) Il differenziale viene trattenuto dalla CC&G

◇ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni intercorrenti tra l'esecuzione del Buy-In ed il buon fine dello stesso o l'eventuale cash settlement;

◇ la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "consegna";

◇ la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna";

◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;

- ◇ la colonna "**titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In;
- ◇ la colonna "**controvalore originario**" indica il controvalore originario della posizione in fail;
- ◇ la colonna "**titoli acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In;
- ◇ la colonna "**titoli acquistati oggi**" indica la quantità di titoli acquistati nella giornata cui si riferisce il report dal Buy-In-Agent;
- ◇ la colonna "**titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In;
- ◇ la colonna "**titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità non sono stati acquistati dal Buy-In Agent nel tempo previsto e che pertanto sono stati sottoposti, come evidenziato nel report ME09, a cash settlement;
- ◇ la sezione "**estremi titoli acquistati oggi**" indica i titoli acquistati dal Buy-In Agent nella giornata nonché il relativo controvalore;
- ◇ la sezione "**Differenziale**" illustra il calcolo del differenziale che il partecipante in fail deve alla 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 (Comparto Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					RP-ME10 26 FEB 04 21:04:46 Pag. 1		
Conto: TERZI									
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In":									
ID Netta: FWT3AD		ID DVP: 1KH1PL							
Simb	ISIN	Data regolamento	Data esecuzione buy-in	Titoli da acquistare originariamente	Controvalore originario	Titoli acquistati nei giorni precedenti	Titoli acquistati oggi	Titoli ancora da acquistare	Titoli sottoposti a cash settlement
MS	IT0001063210	16 FEB 04	25 FEB 04	1.000	8.400,00 CR	0	700	300	0
Compensi inseriti									
Titolo	Simbolo	ISIN	Data eseguito	Data regolamento	Data fine validità	Titoli da ritirare	Controvalore		
Mediaset	MS	IT0001063210	29 FEB 04	2 MAR 04	11 MAR 04	700	5.880,00 DR		

◇ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni intercorrenti tra l'esecuzione del Buy-In ed il buon fine dello stesso o l'eventuale cash settlement;

◇ la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";

◇ la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";

◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;

◇ la colonna "**titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In;

◇ la colonna "**controvalore originario**" indica il controvalore originario della posizione in fail;

◇ la colonna "**titoli acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In;

◇ la colonna "**titoli acquistati oggi**" indica la quantità di titoli acquistati nella giornata cui si riferisce il report dal Buy-In-Agent;

- ◇ la colonna "**titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In;
- ◇ la colonna "**titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità di titoli che per scadenza di termini non saranno acquisiti dal Buy-In Agent e per i quali si procede con il cash settlement;
- ◇ la sezione "**compensi inseriti** " indica i compensi 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 (Comparto Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME13	28 FEB 04	21:04:46 Pag. 1	
Conto: TERZI									
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In" chiusa mediante cash settlement									
ID Netta: FWT3AD		ID DVP: 1KH1PL							
Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni precedenti	titoli acquistati oggi	titoli ancora da acquistare	titoli sottoposti a cash settlement
MS	IT0001063210	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	8.400,00 CR	700	0	0	300
Determinazione del cash settlement:									
Ammontare A									
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 originario		Ammontare B	
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							
Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni precedenti	titoli acquistati oggi	titoli ancora da acquistare	tit sottoposti a cash settlement
ENI	IT0003132476	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	13.000,00 CR	0	0	0	1000
Determinazione del cash settlement:									
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 originario		Ammontare B	
13,20		1000		13.200,00		13.000,00		200,00 €	
Cash settlement = 1310,00 € DR									

◇ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in 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 acquisiti dal Buy-In Agent e per i quali si procede con il cash settlement;
- ◇ la sezione "**Determinazione del cash settlement**" illustra il calcolo dell'ammontare del cash settlement.

## 2.8.26 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							
Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni	titoli acquistati oggi precedenti	titoli ancora da acquistare	titoli sottoposti a cash settlement
MS	IT0001063210	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	8.400,00 CR	700	0	0	300
Determinazione del cash settlement:									
Ammontare A		Nr. titoli		Controvalore		Percentuale		Ammontare A	
Prezzo riferimento giorno esecuzione 9,00		300		2.700,00		10%		270,00 €	
Ammontare B		Nr. Titoli		Controvalore		Controvalore originario		Ammontare B	
Ultimo prezzo riferimento 8,90		300		2.670,00		2520,00		150,00 €	
Cash settlement = 270,00 € DR									
Posizione in stato di "esecuzione Buy-In" chiusa mediante cash settlement									
ID Netta: FW3BD2		ID DVP: 1KH7GK							
Simbolo	ISIN	Data regolamento	data esecuzione buy-in	titoli da acquistare originariamente	controvalore originario	titoli acquistati nei giorni	titoli acquistati oggi precedenti	titoli ancora da acquistare	tit sottoposti a cash settlement
ENI	IT0003132476	16 FEB 04	26 FEB 04	1.000	13.000,00 CR	0	0	0	1000
Determinazione del cash settlement:									
Ammontare A		Nr. titoli		Controvalore		Percentuale		Ammontare A	
Prezzo riferimento giorno esecuzione 13,10		1000		13.100,00		10%		1310,00 €	
Ammontare B		Nr. titoli		Controvalore		Controvalore originario		Ammontare B	
Ultimo prezzo riferimento 13,20		1000		13.200,00		13.000,00		200,00 €	
Cash settlement = 1310,00 € DR									

◇ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, del giorno nel quale si procede alla chiusura del Buy-In mediante cash settlement;

◇ la colonna "**simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";

- ◇ la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";
- ◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;
- ◇ la colonna "**titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In.
- ◇ la colonna "**titoli acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In;
- ◇ la colonna "**titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In.
- ◇ la colonna "**titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità di titoli che per scadenza di termini non saranno acquisiti dal Buy-In Agent e per i quali si procede con il cash settlement;
- ◇ la sezione "**Determinazione del cash settlement**" illustra il calcolo dell'ammontare del cash settlement.

## 2.8.27 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 forzata nonché il differenziale che il partecipante in fail deve corrispondere a CC&G.

### Esempio di Tabulato RP-ME17

Ader: GKK

Esito

RP-ME17 17 FEB 04 21:04:46 Pag. 1

esecuzione Sell-Out

(Comparto Azionario e Derivati Azionari)

CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Conto: TERZI

Posizione in stato di "esecuzione Sell-Out":

ID Netta: I114EW

ID DVP: 9HMLT9

Simbolo	Data ISIN	Data regolamento	Titoli da esecuzione sell-out	Controvalore vendere originariamente	Titoli originario	Titoli venduti nei giorni	Titoli venduti oggi precedenti	Titoli ancora da vendere	Titoli soggetti a restituzione
MS	IT0001063210	16 FEB 04	17 FEB 04	1.000	8.400,00 DR	0	700	300	0

estremi titoli venduti oggi:

Titolo	Simbolo	ISIN	Quantità	Controvalore
Mediaset	MS	IT0001063210	400	3.000,00 CR
Mediaset	MS	IT0001063210	300	2.000,00 CR
Totale			700	5.000,00 CR

Differenziale:

MS	IT0001063210	controvalore originario relativo a: 700 titoli: 5.880,00 DR
MS	IT0001063210	controvalore vendite 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 forzata 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

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

Il tabulato riporta le informazioni relative alla Posizione in stato di esecuzione di Buy-In relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari, il compenso inserito da 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

Simb	ISIN	Data regolame.	Data esecuzione buy-in	Titoli da acquistare originariamente	Controvalore originario	Titoli acquistati nei giorni precedenti	Titoli acquistati oggi	Titoli ancora da acquistare	Titoli sottoposti a cash settlement
QFI	IT0003242598	26 GEN 10	04 FEB 10	18,00	2.839,86 DR	0,00	10,00	8,00	0,00

---

Compensi inseriti nel ciclo netto notturno:

ISIN	Data eseguito	Data regolamento	Data fine validità	Titoli da ritirare	Controvalore
IT0003242598	04 FEB 10	09 FEB 10	18 FEB 10	10,00	1.577,70 DR

◇ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, del giorno successivo alla data di fine validità.

◇ la colonna "**Simbolo**" indica l'acronimo di clearing dello strumento finanziario oggetto di "ritiro";

◇ la colonna "**ISIN**" indica l'ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o "ritiro";

◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento entro la quale la posizione doveva essere regolata per non andare in fail;

◇ la colonna "**Data esecuzione buy-in**" indica la data in cui è stata attivata la procedura di esecuzione di buy-in;

◇ la colonna "**Titoli da acquistare originariamente**" indica la quantità totale di titoli da acquistare per eseguire il Buy-In;

◇ la colonna "**Controvalore originario**" indica il controvalore originario della posizione in fail;

◇ la colonna "**Acquistati nei giorni precedenti**" indica la quantità di titoli già acquistati per il Buy-In o parzialmente consegnati;

◇ la colonna "**Titoli acquistati oggi**" indica la quantità di titoli acquistati nella giornata cui si riferisce il report dal Buy-In-Agent;

- ◇ la colonna "**Titoli ancora da acquistare**" indica la quantità di titoli ancora da acquistare per completare il Buy-In;
- ◇ la colonna "**Titoli sottoposti a cash settlement**" indica la quantità di titoli che non sono stati acquistati dal Buy-In Agent nel tempo previsto e che pertanto sono stati sottoposti, come evidenziato nel report ME09, a cash settlement;
- ◇ la sezione "**Compensi inseriti** " indica i compensi 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				RP-ME40 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								
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
OGTXY9	1705290574581780	CAIRO COMMUNICATION	IT0004329733	01 JUN 17	14 JUN 17	9,00	25,22	MALIS

◇ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Azionario e Derivati Azionari ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni successivi all'originaria data di fine validità della posizione contrattuale non regolata;

◇ la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;

◇ la colonna "**Nuova Fine Val**" indica la data di Fine Validità modificata entro la quale la **posizione dovrà essere regolata per non andare in esecuzione forzata**;

◇ la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a 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

11:47:39 Page 1

Proroga Data Fine Validità Partecipante Diretto

(Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD)

CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

RP-ME41 7 JUN 17

Settlement System : 51 ICSD ECLR/CEDE

Valuta: EUR - EURO

Istruzioni a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare

Conto: Terzi

XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data Regolamen	Nuova Fine Val	Posizioni In fail	Controvalore	Stato
AGKLZS	20170522AGKLZS01	BELGIUM TF 4% MZ32	BE0000326356	24 MAY 17	14 JUN 17	1.000,00	1.409,73	MALIS
AGKLOB	20170522AGKLOB01	BNP FORTIS 5.757% S	BE0933514839	24 MAY 17	14 JUN 17	5.000.000,00	5.322.885,00	BONIS

◇ il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti in fail e per tutti i Partecipanti in bonis e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD ed è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni successivi all'originaria data di fine validità della posizione contrattuale non regolata;

◇ la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;

◇ la colonna "**Nuova Fine Val**" indica la data di Fine Validità modificata entro la quale la **posizione dovrà essere regolata per non andare in esecuzione forzata**;

◇ la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a 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  
(Comparti Azionario e Derivati Azionari)  
CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

RP-ME42 7 JUN 17 11:47:39 Page 1

Settlement System : 60 T2S

Valuta: EUR - EURO

Istruzioni a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare

Conto: Terzi

XIFN	ID	Titolo	ISIN	Data Regolamen	Nuova Fine Val	Posizioni 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 forzata**;
- ◇ la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna "**Member**" indica il codice mnemonico del Cliente Negoziatore;
- ◇ la colonna "**C/H**" indica il conto Proprio ovvero il conto Terzi del Cliente Negoziatore;
- ◇ la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a 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 (Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA				RP-ME43 7 JUN 17 11:47:39 Page 1			
Settlement System : 51 ICSD ECLR/CEDE											
Valuta: EUR - EURO											
Istruzioni a cui è stata modificata la data di fine validità che al termine della giornata continueranno a riciclare											
Conto: Terzi											
XTRN	ID	Titolo	ISIN	Data Regolamen	Nuova Fine Val	Posizioni In fail	Controvalore	Member	C/H		
Stato											
AGJIFS	20170407AGJIFS01	BUND LUG39 EUR 4,	DE0001135325	24 MAY 17	14 JUN 17	1.000,00	1.717,25	ABCD	H		
MALIS											
AGJIFT	20170407AGJIFT01	BUND LUG39 EUR 4,	DE0001135325	24 MAY 17	14 JUN 17	1.000,00	1.717,25	BBBB	C		
BONIS											

- ◇ il tabulato viene prodotto per i Partecipanti Generali e per gli Agenti di Regolamento dei Partecipanti e riporta la posizione dei relativi Clienti Negoziatori in fail ed i Clienti Negoziatori in bonis ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD. Il report è disponibile la mattina, prima dell'avvio delle negoziazioni, nei giorni successivi all'originaria data di fine validità della posizione contrattuale non regolata;
- ◇ la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;
- ◇ la colonna "**Nuova Fine Val**" indica la data di Fine Validità modificata entro la quale la **posizione dovrà essere regolata per non andare in esecuzione forzata**;
- ◇ la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna "**Member**" indica il codice mnemonico del Cliente Negoziatore;
- ◇ la colonna "**C/H**" indica il conto Proprio ovvero il conto Terzi del Cliente Negoziatore;
- ◇ la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a 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
OGTCFX	1705230571624447	SOGEFI	IT0000076536	01 JUN 17	07 JUN 17	1.531,00	2.532,27	BONIS
OGUP5N	1705230571626260	POLIGRAFICI EDIT	IT0000086923	01 JUN 17	07 JUN 17	0,00	0,65	BONIS
OGUKLN	1705230571625813	BUZZI UNICEM ORD.	IT0001347308	01 JUN 17	07 JUN 17	9.960,00	23.007,60	MALIS

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

CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA

Settlement System : 51 ICSD ECLIR/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 forzata**;

- ◇ la colonna **"Posizioni In fail"** indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna **"Controvalore"** indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";
- ◇ la colonna **"Stato"** indica se la posizione non regolata sia in consegna a 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

GOM: GKK		Istruzioni In Esecuzione di Buy In Partecipante Generale (Comparti Azionario e Derivati Azionari) CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA					RP-ME46 7 JUN 17 11:47:39 Page 1				
Settlement System : 60 T2S											
Valuta: EUR - EURO											
Istruzioni che al termine della giornata sono state cancellate dal sistema di liquidazione e poste in esecuzione											
Conto: Terzi											
</											

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

### Esempio di Tabulato RP-ME47

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

◇ la colonna "**Titolo**" indica la descrizione dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**ISIN**" indica il codice ISIN dello strumento finanziario oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Data di regolamento**" indica la data di regolamento originaria entro la quale la **posizione doveva essere regolata per non andare in fail**;

◇ la colonna "**Fine Val**" indica la data di Fine Validità della **posizione oltre la quale si procede con l'esecuzione forzata**;

◇ la colonna "**Posizioni In fail**" indica la quantità totale di titoli non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Controvalore**" indica il controvalore della posizione non regolata oggetto di "consegna" o di "ritiro";

◇ la colonna "**Member**" indica il codice mnemonico del Cliente Negoziatore;

◇ la colonna "**C/H**" indica il conto Proprio ovvero il conto Terzi del Cliente Negoziatore;

◇ la colonna "**Stato**" indica se la posizione non regolata sia in consegna a 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: EU000A1GQAB4		EFSF IG21 EUR 3,375					
TRN ORIGINALE: 2012072000ABCN01							
	TRN	Tipo	Data regolamento	Scadenza fail consegnare	Titoli da ricevere	Titoli da Controvalore Val	
ISTRUZIONE PARZIALE EUR	2012072000ABC1H1	I	18LUG12	01AUG12	0	5.000.000	5.005.000,25
ISTRUZIONE PARZIALE EUR	2012072000ABC2H1	I	18LUG12	01AUG12	0	5.000.000	5.005.000,25
ISTRUZIONE CANCELLATA EUR	2012072000ABC3H1	C	18LUG12	01AUG12	0	10.000.000	10.010.000,50
ISIN: DE000A0GTCE9		Deutsche Tel					
TRN ORIGINALE: 2012072000001N01							
	TRN	Tipo	Data regolamento	Scadenza fail	Titoli da consegnare	Titoli da ricevere	Controvalore Val
ISTRUZIONE PARZIALE EUR	20120720000011P1	I	17LUG12	31LUG12	0	70.000	70.086,26
ISTRUZIONE PARZIALE EUR	20120720000012P1	I	17LUG12	31LUG12	0	30.000	30.036,97
ISTRUZIONE CANCELLATA EUR	20120720000013P1	C	17LUG12	31LUG12	0	100.000	100.123,23

◇ 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	LDDBS57F07T682S					
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 al Comparto Derivati su Commodity Agricole.

#### **Esempio di Tabulato RP-MB01**

Page 1

Mbr: XXXXXXXXXXXX

Basilea III - AGRX asset class

RP-MB01

1 JUN 21 14:45:05

Update at: 31 MAY 21

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	200.000
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	615,87
04	DFcCM	Sum of clearing members' contractually committed default fund contributions	300.000
05	Initial margin	Total amount of initial margin	0
06	C-FACTOR	C-Factor	0,16 %

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

## 2.10.2 RP-MB02 Equity Derivates asset class

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

### Esempio di Tabulato RP-MB02

Page 1

Mbr: XXXXXXXX

Basilea III - Equity Deriv. asset class

RP-MB02

1 JUN 21 14:45:05

Update at: 31 MAY 21

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

◇ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Derivati su Equity ed è disponibile entro il quinto giorno lavorativo successivo alla data di calcolo di fine mese.

◇ 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 al Comparto Derivati su Energy.

#### **Esempio di Tabulato RP-MB03**

Page 1

Mbr: xxxxxxxx

Basilea III - IDEX asset class

RP-MB03

1 JUN 21 14:45:05

Update at: 31 MAY 21

Energy Derivatives asset class			
Ref:	Basel Parameter	Description	Value
01	KCCP	Hypothetical capital of the CCP	1.578
02	DFCM	Sum of clearing members' pre-funded default fund contributions	1.250.000
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	3.849,24
04	DFcCM	Sum of clearing members' contractually committed default fund contributions	1.875.000
05	Initial margin	Total amount of initial margin	1.030.558,2
06	C-FACTOR	C-Factor	0,16 %

◇ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Derivati su Energy ed è disponibile entro il quinto giorno lavorativo successivo alla data di calcolo di fine mese.

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

## 2.10.4 RP-MB04 BOND asset class

Il tabulato riporta le informazioni relative al Comparto Repo.

### **Esempio di Tabulato RP-MB04**

Page 1

Mbr: XXXXXXXX

Basilea III - BOND asset class

RP-MB04

1 JUN 21 14:45:05

Update at: 31 MAY 21

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

◇ Il tabulato viene prodotto per tutti i Partecipanti Generali/Individuali del Comparto Repo ed è disponibile entro il quinto giorno lavorativo successivo alla data di calcolo di fine mese.

◇ La descrizione delle voci dei campi è analoga a quella riportata nel paragrafo RP-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. Settlm. 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. Settlm. 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. Settlm. 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. Settle. Date:		09/12/2013	
CSD=Contractual Settlement Date	: 02/12/2013	ASD=Actual Settlement Date		02/12/2013	
CVD=Coupon Value Date	: 09/12/2013	RD/RPD=Record Date/Redemption Payment Date		29/11/2013	
IPED=Interest Period Ending Date	: 09/12/2013	Tasso Interesse:			
CCV=Coupon Compensation Value Date	:	Nominal Value	:		
				-----	
		Importo a Debito		10.000,00 DB	

### 2.11.3 RP-MS38 Saldi Coupon Compensation – Comparto Obbligazionario ICSD

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

#### Esempio di Tabulato RP-MS38

Mor: AKK		Balances Coupon Compensatio		RP-MS38	24 OCT'18	19:51:28	1
		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
Account : xxxxxx							
Currency: USD USD - U.S. DOLLAR							
Causal : CA CORPORATE ACTION							
Mor	Isin	Tm	CVD Date	ASD Date	Provisional Amount	Definitive Amount	Total Amount
AKK	US912828TS94	20170330BGJECJP1	31/03/2017	7/04/2017		468,75 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJECMP1	31/03/2017	10/04/2017		8.509,38 D	
AKK	US912828TS94	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

Div: GKK		Balances Coupon Compensation				RP-MS40	24 OCT'18
19:51:28	1						
Mor: AKK		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
Account : xxxxx							
Currency: USD USD - U.S. DOLLAR							
Causal : CA CORPORATE ACTION							
Mor	Isin	Tm	CVD Date	ASD Date	Provisional Amount	Definitive Amount	Total Amount
AKK	US912828TS94	20170330BGJECJP1	31/03/2017	7/04/2017		468,75 D	
AKK	US912828TS94	20170330BGJECMP1	31/03/2017	10/04/2017		8.509,38 D	
AKK	US912828TS94	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

## 2.11.5 RP-MS39 Pagamenti Saldi Coupon Compensation – Comparto Obbligazionario ICSD

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

### Esempio di Tabulato RP-MS39

Mor: AKK		Payments Balances Coupon Compensation		RP-MS39	26 OCT 18	19:30:06	Page 1
		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
		Payment Date: 26/10/2018					
Account :	xxxxx						
Currency:	USD USD - U.S. DOLLAR						
Causal :	CA CORPORATE ACTION						
				Definitive Amount	Total Amount	Payment Executed	
Mor	Isin	Tm	CVD Date ASD Date				
AKK	XS0211034466	20131031AAAPT01	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
Mor : GKK		CC&G - Cassa Compensazione e Garanzia					
		Payment Date: 26/10/2018					
Account : xxxxxx							
Currency: EUR -EURO							
Causal : CA CORPORATE ACTION							
Mor	Isin	Tm	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 - Commodity 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		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 - Commodity 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		GIORNI	NR.DEBITORI	NR.CREDITORI
VALUTA	D A R E	A V E R E			
1/07/2014	0,00	36.055.777,22	1	0,00	36.055,77
7/07/2014	0,00	36.040.000,00	1	0,00	36.040,00
9/07/2014	0,00	33.617.000,00	1	0,00	33.617,00
6/08/2014	0,00	21.651.000,00	1	0,00	21.651,00
3/09/2014	0,00	22.865.000,00	1	0,00	22.865,00
<hr/>					
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	TASSO %	NUMERI	INTERESSI
DECORRENZA			
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-
<hr/>			
TOTALE LORDO		150.228,77	33,24
TOTALE INTERESSI NETTI			33,24
SPESE ESTRATTI CONTO			2,50-
<hr/>			
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 VALUTA	SALDI PER VALUTA EURO		GIORNI	NR.DEBITORI	NR.CREDITORI
	D A R E	A V E R E			
1/07/2014	0,00	36.055.777,22	1	0,00	36.055,77
7/07/2014	0,00	36.040.000,00	1	0,00	36.040,00
9/07/2014	0,00	33.617.000,00	1	0,00	33.617,00
6/08/2014	0,00	21.651.000,00	1	0,00	21.651,00
3/09/2014	0,00	22.865.000,00	1	0,00	22.865,00
SALDO CONTABILE	0,00	150.228.777,22		0,00	150.228,77

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				
	da data :	1/07/2014	a data :	30/09/2014		
	CASSA DI					
	COMPENSAZIONE					
	E GARANZIA S.p.A.	00000 BANCA xxxx				
		Via Nome, 00				
		0000 ROMA				
DEFINITIVA						
			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	RESTITUIZ. 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		GIORNI	NR.DEBITORI	NR.CREDITORI
VALUTA	D A R E	A V E R E			
1/07/2014	0,00	36.055.777,22	1	0,00	36.055,77
7/07/2014	0,00	36.040.000,00	1	0,00	36.040,00
9/07/2014	0,00	33.617.000,00	1	0,00	33.617,00
6/08/2014	0,00	21.651.000,00	1	0,00	21.651,00
3/09/2014	0,00	22.865.000,00	1	0,00	22.865,00
<hr/>					
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-	
<hr/>				
TOTALE LORDO		150.228,77	33,24	
TOTALE INTERESSI NETTI			33,24	
SPESE ESTRATTI CONTO			2,50-	
<hr/>				
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	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	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	RESTITUIZ. 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 COMPENSAZIONE E GARANZIA S.p.A.

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

00000 BANCA xxxx

Via Nome, 00

0000 ROMA

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

CC&G

Estratto Conto Scalare

RP-MMT2

6 OCT 14

18:07:01

Pag. 1

DF MMT - Merc.Int.Collater.

CASSA DI COMPENSAZIONE E GARANZIA S.p.A.

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

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:
  - o l'informativa sulla posizione finanziaria del Partecipante relativamente ai Default Funds;
  - o 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 contiene l'informativa sulla posizione finanziaria del Partecipante relativamente ai Default Funds e l'informativa sulla richiesta di versamento di margini infragiornalieri.

#### Tracciato Record Messaggio M01

Tipo messaggio: M01  
 Applicazione bancaria mittente: 90000CG011YY<sup>1</sup>  
 Applicazione bancaria destinataria: FFFFF<sup>2</sup>CG011YY<sup>1</sup>  
 Categoria applicativa: CG01

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

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

<sup>2</sup> 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|0000005000000000|D|00000000)

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

Dettaglio causali (N01) del messaggio M01

100 → 199: Non attivo

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

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

#### Margini attuali e relativa copertura

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

#### Adeguamento mensile dei margini

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

#### Contribuzioni

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

400 → 499: Margini infragiornalieri

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

#### (Margini Aggiuntivi Infragiornalieri)

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

*Legenda causali del messaggio M01*

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

“Margini attuali e relativa copertura” (X01-X06),

“Adeguamento mensile dei margini” (X11-X14),

“Quote, Commissioni e Interessi” (X21-X24).

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

**Default Funds:**

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

**Margini infragiornalieri**

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

### 3.3.2 Messaggio M03

Il messaggio M03 inoltrato tramite la Rete Nazionale Interbancaria, consente al Partecipante o al relativo Agente di Regolamento del contante di disporre delle informazioni relative agli addebiti e agli accrediti che saranno effettuati nella giornata sul proprio conto PM in Target2 da 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 - codice CAB Partecipante - Descrizione Partecipante - Importo - Segno - Codice Divisa - Mercato - Tipo Pagamento - Data Pagamento - Causale - Riferimento Operazione - Codice Conto Gestione - Tipo Conto - Campo Commento	"5"n/ "5"n/ "40"b/ "15"n/ "1"b/ "3"b/ "3"b/ "3"b/ "8"n/ "2"b/ "6"b/ "5"n/ "1"b/ "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.O.**

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:I298XXXXXXXXXXXXXX}
{3:{108:0089430070190000}}
{4: :20:0089430070190000 :12:003
:77E:CCG - Notice of N. 2 deb/cred payments on 2008-09-23
P01-L19999900000DENOMINAZIONE SOCIALE 000000007201875DEUR
P01-L2MIFADG20080923PA10222590000P/VARIE/MIF-ADG-99999-P-}
P02-L19999900000DENOMINAZIONE SOCIALE 000000486507677CEUR
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 negozianti potranno utilizzare le linee già operative per l'accesso al mercato, scegliendo il protocollo di comunicazione di tipo HTTPS o VPN client. I Partecipanti che svolgono il ruolo di Clearer Puro dovranno invece attivare la connessione su linea dedicata con protocollo di comunicazione di tipo HTTPS o VPN client o su Internet con protocollo di comunicazione di tipo HTTPS, VPN Client o VPN tunnel IP sec.

## 4.2 Sezione II: ICWS

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

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

### **Orari di utilizzo**

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

### **Versioni**

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

### **Configurazioni**

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

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

### **Connettività e protocollo di comunicazione**

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

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

Si indica di seguito, per ciascuna tipologia di Partecipante, la dotazione tecnologica richiesta da 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



[www.ccg.it](http://www.ccg.it)