

06 May 2022

Modifica dei campi “Tipo transazione” e “Indicatore di parzializzazione” in T2S

All'attenzione di:	Tutti i Partecipanti
Priorità:	Media
Argomento:	Modifica dei campi Tipo transazione e Indicatore di parzializzazione in T2S

Gentile Cliente,

nell'ambito dell'implementazione della normativa CSDR, a partire dal 30 maggio 2022, per tutte le istruzioni generate e inviate in T2S a partire dal 09 maggio 2022, la compilazione dei campi “Tipo transazione” e “Indicatore di parzializzazione” sarà modificata come descritto di seguito.

Tipo transazione:

Il valore riportato sarà coerente con il tipo di contratti sottostanti il saldo:

- **TRAD**: saldi netti composti unicamente da operazioni di compravendita;
- **REPU**: saldi netti composti unicamente da operazioni Repo/Reverse repo in cui il partecipante è sempre un datore dei titoli/venditore (il partecipante consegna titoli a pronti o riceve titoli a termine);
- **RVPO**: saldi netti composti unicamente da operazioni Repo/Reverse repo” in cui il partecipante è sempre prenditore dei titoli/acquirente (il partecipante riceve titoli a pronti o consegna titoli a termine);
- **NETT**: saldi netti composti da almeno due delle seguenti operazioni: Repo, reverse repo, compravendite

This publication is for information purposes only and is not a recommendation to engage in investment activities. This publication is provided “as is” without representation or warranty of any kind. Whilst all reasonable care has been taken to ensure the accuracy of the content, Euronext does not guarantee its accuracy or completeness. Euronext will not be held liable for any loss or damages of any nature ensuing from using, trusting or acting on information provided. No information set out or referred to in this publication shall form the basis of any contract. The creation of rights and obligations in respect of financial products that are traded on the exchanges operated by Euronext's subsidiaries shall depend solely on the applicable rules of the market operator. All proprietary rights and interest in or connected with this publication shall vest in Euronext. No part of it may be redistributed or reproduced in any form without the prior written permission of Euronext.

Euronext refers to Euronext N.V. and its affiliates. Information regarding trademarks and intellectual property rights of Euronext is located at [euronext.com/terms-use](https://www.euronext.com/terms-use).

© 2022, Euronext N.V. - All rights reserved.

Indicatore di parzializzazione:

L'indicatore di parzializzazione riportato sulle istruzioni di liquidazione in T2S sarà PARQ (liquidazione parziale consentita con quantità minima 0) per le istruzioni di liquidazione su tutti tipi di strumenti finanziari ad eccezione dei titoli di Stato.

Piano di collaudo

Le modifiche saranno disponibili nell'ambiente di test CDS a partire dalla data del 9 maggio. Euronext Clearing garantirà il supporto ai Partecipanti durante la fase di test sulla base del seguente piano:

	Attività oggetto del test	Esito atteso	Lista di Isin oggetto del test
Transaction type	<ul style="list-style-type: none"> - Inserimento dei contratti; - Generazione del saldo; - Compilazione del campo "Tipo transazione" 	Corretta valorizzazione del campo "Tipo transazione2 secondo i valori riportati sopra.	IT0004545890 IT0005217390 IT0004848831 IT0000062072 IT0000072170 IT0005108490 IT0005388639 FR0010010827
Indicatore di parzializzazione	<ul style="list-style-type: none"> - Inserimento dei contratti; - Generazione del saldo; - Compilazione del campo "Indicatore di parzializzazione". 	Corretta valorizzazione del campo "Indicatore di parzializzazione". secondo i valori riportati sopra	

I partecipanti potranno provvedere all'inserimento di contratti in ambiente CDS al fine di generare i saldi di liquidazione e le corrispondenti istruzioni di regolamento in T2S.

Per ulteriori informazioni si prega di contattare:

T: +39 06 32 395 303

E: ccp-helpdesk.settlement@euronext.com