
CC&G Market Notice

23 Febbraio 2021

Pricing SSDF e Futures FTSE Mib Dividend Inserimento di BTP Futura e Bond EU SURE tra i titoli depositabili a collaterale

All'attenzione di: **Tutti i Partecipanti**
Priorità: **Media**
Argomento: **Pricing Dividend Futures**
Garanzie in titoli

Gentile Cliente,

La informiamo che a decorrere dal giorno **9 Marzo 2021** CC&G introdurrà le seguenti modifiche, che andranno rispettivamente:

(a) ad introdurre, per quanto riguarda i Single Stock Dividend Futures (SSDF) e Futures sull'indice FTSE Mib Dividend, il calcolo del prezzo teorico, da utilizzarsi in via residuale in caso di indisponibilità di quotazioni di mercato, a complemento della metodologia di calcolo del prezzo di regolamento giornaliero già in uso;

(b) ad includere i titoli emessi dall'Unione Europea nel contesto del programma di finanziamento SURE (Bond SURE) ed i titoli di Stato Italiani cd. step-up (BTP Futura) tra i titoli depositabili a garanzia presso il sistema. Al seguente link sono riportati i criteri di eleggibilità e gli haircut applicati (disponibili a partire dal 9 Marzo): <https://www.lseg.com/markets-products-and-services/post-trade-services/ccp-services/ccq-italian-version/risk-management/parametri>



London
Stock Exchange Group

Market Notice

23 Febbraio 2021

Le modifiche relative agli Allegati alle Istruzioni al Regolamento di CC&G, segnatamente Allegati n. B.313 e B.332, entreranno in vigore il giorno **9 marzo 2021**.

Lo stralcio del testo degli Allegati alle Istruzioni, con evidenza delle modifiche, è pubblicato sul sito internet di CC&G www.lseg.com/ccg alla sezione "Rules and Regulations".

Per eventuali ulteriori informazioni, si prega di contattare:

Sales & Relationship Management

E-mail: ccpsales@lseg.com

Phone: +39 02 72426504

Risk Management & Membership:

E-mail: membership1@lseg.com

Phone: +39 02 72426 501