

CC&G Market Notice

01/07/2020

Modifica nel tasso di riferimento sul contante depositato da EONIA a €STR

All'attenzione di:

Partecipanti Diretti

Priorità:

Alta

Argomento:

Tasso d'interesse sul contante depositato

Gentile Cliente,

a partire dal 1 Ottobre 2020, CC&G adotterà €STR quale tasso di riferimento per il calcolo degli interessi sul contante depositato a titolo di Margini e Default Fund.

Attualmente gli interessi sul contante depositato a titolo di Margini sono calcolati sulla base del tasso EONIA giornaliero meno 30 punti base, mentre gli interessi sul contante depositato a titolo di Default Fund sono calcolati sulla base del tasso EONIA giornaliero meno 25 punti base.

Poiché il nuovo tasso €STR è inferiore di 8,5 punti base rispetto al tasso EONIA, CC&G ha stabilito di modificare lo spread al fine di mantenere invariato il tasso finale applicato al cliente.

Di conseguenza, i nuovi tassi di interesse sul contante depositato verranno calcolati nel seguente modo:

- a titolo di Margini: €STR meno 21,5 punti base
- a titolo di Default Fund: €STR meno 16,5 punti base

Vi comunichiamo infine che gli interessi del quarto trimestre saranno liquidati, come di consueto, a gennaio 2021.

La versione aggiornata dei Corrispettivi è disponibile sul sito di CC&G al seguente link:

<https://www.lseg.com/markets-products-and-services/post-trade-services/ccp-services/ccg/membership/pricing>

Per eventuali ulteriori informazioni, si prega di contattare:

Post Trade Sales

E-mail: CCPSales@lseg.com

Tel: +39 02 72426504

Membership

E-mail: client.services.ccg@lseg.com

Tel: +39 02 72426501



London

Stock Exchange Group