

11 maggio 2022

ON_18/2022

Indicatore tipo Transazione e Parzializzazione su saldi netti garantiti

All'attenzione di:	DCP, ICP
Priorità:	Media
Argomento:	Indicatore tipo Transazione e Parzializzazione su saldi netti garantiti

Gentile Cliente,

In seguito alla richiesta delle CCP e dell'implementazione CSDR sul mercato garantito, a partire dal 30 Maggio 2022 i campi "Tipo Transazione" e "Indicatore Parzializzazione" verranno modificati per le istruzioni di regolamento legate a saldi netti garantiti.

Il valore "Tipo Transazione" riportato sulle istruzioni sarà consistente con la tipologia di contratti che compongono il saldo garantito e sarà applicato come segue:

- **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 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 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 <https://www.euronext.com/terms-use>.

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

Questa nuova logica di applicazione del Tipo Transazione sarà applicata a tutte le istruzioni relative a saldi netti garantiti da Euronext Clearing e/o da LCH SA.

Il valore dell' Indicatore di Parzializzazione, per le sole istruzioni di regolamento legate ai saldi netti garantiti con Euronext Clearing, sarà applicato in base al set up richiesto da Euronext Clearing considerando il tipo di strumento finanziario.

Le nuove funzionalità, attualmente già disponibili in test, saranno limitate ai soli saldi netti garantiti senza impatti sulle transazioni sui mercati non garantiti e OTC.

Per ulteriori informazioni si prega di contattare:

OPE SET

Email: mt-helpdesk.settlement@euronext.com