
Operational Notice

23 gennaio 2019
ON_08/2019

Gestione CAOF sui diritti di opzione

All'attenzione di:

DCPs, ICPs

Argomento:

Gestione CAOF sui diritti di opzione

Gentile Cliente,

con riferimento al processo di gestione delle CAOF per l'evento "EXRI CHOS", con opzione di default "LAPS", si rammenta che, in conformità allo standard numero 3 del CASG che indica le regole cui attenersi per la gestione delle Transformation, Monte Titoli opera come segue:

1. Cancella, alla data di "fine operazione" (ultimo giorno di esercizio dei diritti) le Settlement Instruction sui diritti d'opzione non regolate (pending);
2. Genera, a favore dell'acquirente del diritto di opzione in bonis, un'istruzione (PFOD) per il regolamento di un controvalore cash pari all'ammontare dell'operazione cancellata.

Le previsioni di cui sopra sono state concordate in occasione dello NSG lo scorso 6 Luglio 2018, riguardo al tema "IT AMI-SeCo NSG - Follow up to May 2018 CASG gap analysis survey: issue related to the processing of rights exercise in the IT market".

Il nuovo testo delle Istruzioni di regolamento del Servizio di Liquidazione saranno aggiornate per tenere conto di quanto sopra.

Per ogni ulteriore richiesta di chiarimento in merito si prega di fare riferimento al seguente indirizzo:

Settlement Operations

e-mail: helpdesk.settlement@lseg.com