

11 January 2024

ON_02/2024

Introduzione modalità di regolamento netting su mercato primario Domestic MOT non garantito - testing

To the attention of:	DCPs, ICPs
Topic:	Gestione del Regolamento riguardante le emissioni del BTP da parte del MEF - testing

Gentile Cliente

Con riferimento alla ON nr. 49/2023, di seguito le informazioni necessarie per eseguire i test programmati. Tali informazioni sono state stabilite e condivise con il mercato.

Per una gestione efficace delle casistiche relative alle tipologie di BTP, abbiamo censito gli strumenti finanziari da utilizzare nelle tre settimane schedate pensate come tre cicli di collocamento, dove i primi due giorni di ogni settimana di testing saranno di trading, mentre il venerdì di ogni settimana corrisponderà alla settlement date.

Per il BTP Italia abbiamo pensato di proporre due cicli di test, mentre per il BTP Futura (stesso trattamento del BTP Valore) il test dovrà essere eseguito nella settimana centrale.

Settimana BTP ITALIA (negoiazione dal 5 al 6 febbraio, regolamento 9 febbraio):

9/2/24 – 9/2/29 cedola 2% annuale, pagamento semestrale, primo stacco 9/8/24 inizio godimento 9/2/24

IT0005532715 CUM

IT000EX12343 EX

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.

Settimana BTP VALORE (negoziazione dal 12 al 13 febbraio, regolamento 16 febbraio)

16/2/24 – 16/2/29 cedola 4,1% annuale, pagamento trimestrale, primo stacco 16/5/24
inizio godimento 16/2/24

IT0005565392

Settimana BTP ITALIA (negoziazione al 19 al 20 febbraio, regolamento 23 febbraio)

23/2/24 – 23/2/29 cedola 2% annuale, pagamento semestrale, primo stacco 23/8/24 inizio
godimento 23/2/24

IT000CUM1235

IT000EX11345

Per ulteriori informazioni, non esitate a contattare all'indirizzo:

clientsupport@euronext.com per il mercato

helpdesk.settlement@euronext.com per Euronext Securities Milan