
Market Notice

2 maggio 2017
MN_40/2017

Avvio Classic Repo

All'attenzione di: DCPs, ICPs
Priorità: ALTA
Argomento: Avvio Classic Repo

Gentile Cliente,

abbiamo il piacere di comunicare che Monte Titoli, in collaborazione con i mercati MTS, Brokertec ed e-MID e le Controparti Centrali Cassa di Compensazione e Garanzia e LCH SA, ha definito le modalità di migrazione da Buy and Sell Back a Classic Repo il cui avvio in produzione è previsto, fatto salvo il buon esito dei test, per il prossimo 24 luglio 2017.

Alla luce di quanto sopra:

- i Mercati, a decorrere dalla migrazione, invieranno a regolamento solo contratti di tipo "Repo", garantiti e non garantiti, di tipo "Classic" e non invieranno più contratti di tipo "Buy Sell Back";
- per i contratti garantiti dalle CCPs le stesse utilizzeranno un conto distinto per segregare gli importi derivanti dal pagamento delle cedole;
- i Mercati al momento non hanno in piano di rendere negoziabili contratti Repo con tasso variabile.

Il Modello Operativo Classic Repo, pubblicato sul sito Monte Titoli ([link](#)) in data 9 agosto 2016, descrive nel dettaglio i requisiti funzionali relativi alla gestione dei contratti Classic Repo nel servizio di post-trading X-TRM e illustra le modifiche tecniche ed operative predisposte.



London
Stock Exchange Group

Market Notice

Per permettere a tutti i Partecipanti di verificare la corretta gestione dei contratti Classic Repo è stato pianificato un periodo di collaudo tra il 13 giugno 2017 e il 21 luglio 2017 ed è stato predisposto il Piano dei test riportante le linee guida per l'esecuzione dei test. Il Piano dei test e la documentazione di supporto sono pubblicati nella sezione documentale della piattaforma MT-X, nella cartella "*Documentazione / T2S – Change Management & Client Test Plan / T2S Client Test Plans / Classic Repo*".

Monte Titoli è parte attiva del processo di collaudo e provvederà a fornire il pieno supporto ai propri Clienti, ai Mercati e alle CCPs al fine di assicurare il buon esito dei collaudi.

Per quanto attiene alla necessità espressa da alcuni Partecipanti di disporre quanto prima di un riferimento per il collegamento della cedola con il contratto originale, Monte Titoli informa che sono state condivise con il gruppo tecnico del PTPC – T2S Change Management sia le modalità tecniche di implementazione che l'elevata priorità realizzativa e che, entro il 15 maggio 2017, sarà sottoposta al citato gruppo, per condivisione, un'ipotesi di pianificazione di una nuova release.

Per ogni richiesta di supporto di tipo operativo o funzionale durante la fase di test si prega di fare riferimento al seguente indirizzo:

mt-test-sett@lseg.com

mentre per richieste di informazioni generali si prega di contattare:

ptclient@lseg.com

phone: + 39 02 33635 640