
Market Notice

29 febbraio 2016

MN_20/2016

Indici Eurostat - ribasamento per le componenti cedolari dei BTP€i già strippate

All'attenzione di:

Priorità:

Argomento:

DCPs, ICPs

MEDIA

BTP€i e coupon stripping

Gentile Cliente,

desideriamo informarla che dal 1° marzo 2016 l'indice Eurostat cambierà l'anno di riferimento delle serie degli indici armonizzati dei prezzi al consumo (ribasamento)¹.

Per effetto di tale adeguamento, al fine di assicurare la coerenza dei saldi relativi alle componenti cedolari dei BTP in euro indirizzati (BTP€i) già strippati con le equivalenti posizioni che verranno a determinarsi dalle operazioni di stripping effettuate dopo il ribasamento, Monte Titoli provvederà ad effettuare - in data 1 marzo 2016, le opportune attività correttive anagrafiche e contabili. Queste ultime verranno effettuate mediante operazioni di accredito (MKUP) sui conti di gestione accentrata interessati ed utilizzando una specifica Chiave di Ribasamento (CR=0.85453459602423).

Di seguito i dettagli operativi:

- Titoli interessati: la lista dei titoli interessati è pubblicata nella sezione documentale di MT-X – Coupon Stripping Titoli Indicizzati - Elenco Titoli Indicizzati EUROSTAT oggetto di ribasamento (1 marzo 2016);
- Posizioni impattate: conti titoli che, alla chiusura del 29.02.16 (RD), hanno posizioni sulle componenti cedolari interessate;
- Calcolo dell'importo da accreditare: $MKUP = [(\text{Saldo a RD} / CR) - \text{Saldo a RD}]$
 - Arrotonda $((\text{Saldo a RD} / CR); 2) - \text{Saldo a RD}$

¹ Per i dettagli si veda il sito di Eurostat al seguente [link](#).



London

Stock Exchange Group

Market Notice

29 febbraio 2016

MN_20/2016

Di seguito si riporta un esempio di calcolo:

nozionale attuale : 2.314,60

CR=0.85453459602423

nozionale ribasato = arrotonda($2314.60 / 0.85453459602423$);2 = 2708.61

- accredito (MKUP) = $2708.61 - 2.314,60 = 394,01$

Per ulteriori informazioni, si prega di contattare:

Direct Custody

e-mail: helpdesk.domesticcustody@lseg.com

phone Tel: +39.02.33635.393

Client Services

e-mail: pt.clientservices@lseg.com

phone Tel: +39.02.33635.640