

Market Notice

6 marzo 2019
MN_06/2019



London
Stock Exchange Group

Convenzioni di calcolo dei ratei

All'attenzione di: **Emittenti e Intermediari**

Argomento: **Convenzioni di calcolo dei ratei**

Gentile Cliente,

EMMI (European Money Markets Institute), amministratore dei tassi Euribor, ha comunicato che cesserà al 31 marzo 2019 la pubblicazione dei tassi Euribor secondo le convenzioni "Act/365 giorni" e "30/360 giorni".

EMMI ha comunicato una modalità con cui derivare dalla convenzione "Act/360" le convenzioni dismesse ed ha suggerito di fare ricorso alle seguenti formule:

$$\text{ACT/365} = (\text{act}/360) * (365/360)$$

$30/360 = (\text{act}/360) * (\text{Act daycount}/30_360 \text{ daycount})$ ove Act daycount è il numero di giorni tra data regolamento e data scadenza cedola.

Monte Titoli sta valutando eventuali impatti sui propri servizi, i partecipanti agli stessi saranno informati in merito ai risultati della valutazione.

Per ulteriori chiarimenti vi invitiamo a contattare Sales Team:

mail: salesteam@lseg.com

tel. +39 02 72426504