

Calcolo Penali

Descrizione del Report fornito agli Intermediari

Versione 1.0

6 settembre 2011

SOMMARIO

OGGETTO DEL DOCUMENTO	3
1. CRITERI DI APPLICAZIONE DELLE PENALI	3
2. DESCRIZIONE REPORT DI FINE GIORNATA	3

OGGETTO DEL DOCUMENTO

Facendo seguito alla comunicazione inerente al modello di applicazione delle penali con i relativi esempi, pubblicata sul sito Monte Titoli in data 19 agosto 2011, vengono descritti, nel presente documento, i campi contenuti nel report “calcolo delle Penali” inviato giornalmente agli Intermediari dal servizio Express II.

1. CRITERI DI APPLICAZIONE DELLE PENALI

Sono oggetto di applicazione delle penali, tutte le posizioni scoperte di titoli che alla chiusura del sistema RTGS (attualmente alle 18.00), restano non regolate (indipendentemente dalla *Intended Settlement Date*).

2. DESCRIZIONE REPORT DI FINE GIORNATA

Giornalmente verrà prodotto un report (formato CSV con separatore tra i campi “;”) inviato ai liquidatori per tutti i loro conti di regolamento automaticamente dal sistema Express II tramite e-mail. Di seguito la descrizione dei campi che costituiscono la struttura del report giornaliero:

ID	CAMPO	CONTENUTO	FORMATO
1	ACTUAL_SETTLEMENT_DATE	Data di regolamento	yyyymmdd
2	ACCOUNT	Codice ABI	5 n
3	SETTLEMENT_AGENT	Codice CED con relativa descrizione	61 a
4	ISIN	Codice dello strumento finanziario	12 a
5	ISIN_DESCRIPTION	Denominazione del titolo	20 a
6	ASSETS_CLASS	Descrizione della qualità del titolo ¹	30 a
7	CURRENCY	Divisa di emissione del titolo (ISO)	3 a
8	PRICE	Prezzo del titolo	Campo numerico con un massimo di 4 decimali

¹ Titoli azionari nominativi, Titoli a reddito fisso, Fondi comuni italiani, Warrant, etc

9	AVAILABILITY	Saldo custody presente in Monte Titoli ²	Campo numerico
10	SM_DAY	Saldo multilaterale di giornata ³	Campo numerico con segno ⁱ
11	SM_PREVIOUS	Saldo multilaterale della giornata precedente ⁴	Campo numerico con segno ⁱⁱ
12	SMT	Saldo multilaterale	Campo numerico ⁱⁱⁱ
13	SHORT_POSITION	Controvalore della posizione corta sul quale calcolare la penale	Campo numerico con segno con un massimo di 2 decimali
14	LONG_POSITIONS	Controvalore della posizione lunga sul quale calcolare il bonus	Campo numerico con segno con un massimo di 2 decimali
15	PENALTY	Importo della penale da applicare	Campo numerico con segno con un massimo di 2 decimali
16	THEORIC_BONUS_AMOUNT	Importo del bonus teorico	Campo numerico con un massimo di 2 decimali
17	INDEX_OF_REBASED	Coefficiente di distribuzione ⁵	Campo numerico con un massimo di 4 decimali
18	REAL_BONUS_AMOUNT	Importo del bonus da riconoscere al partecipante	Campo numerico con un massimo di 2 decimali

i La virgola è indicata solo in presenza di decimali significativi

ii Vedi nota precedente

iii Vedi nota precedente

² Per azioni e assimilabili rappresenta la quantità, per obbligazioni il saldo nella valuta di denominazione dello strumento finanziario

³ Vedi nota 2

⁴ Vedi nota 2

⁵ Questo dato viene calcolato con la seguente formula: PENALE NETTA /TOTALE BONUS per ISIN