

10 GENNAIO 2012

# Coupon stripping

## Descrizione dei report

<b>1.</b>	<b>DESCRIZIONE REPORT A</b> .....	<b>3</b>
<b>2.</b>	<b>DESCRIZIONE REPORT B</b> .....	<b>4</b>

## Oggetto del documento

Facendo seguito alla comunicazione sulla pubblicazione dei nuovi modelli “Report Coupon Stripping”, con i relativi esempi, vengono descritti, nel presente documento, i campi contenuti nei report disponibili sul sito di Monte Titoli al seguente indirizzo e aggiornati su base settimanale.

I report inviati sono:

- di tipo generale (Report A) nel quale vengono evidenziati i saldi totali a livello di Titolo Padre sia per il totale assoggettato che l'assoggettabile, nonché il saldo per date delle cedole strippate
- di tipo specifico (Report B) nel quale vengono evidenziati (sulla stessa riga) per ogni codice ISIN di titolo padre con il relativo codice ISIN del mantello, l'elenco per date di tutti i codici ISIN cedola per tutte le scadenze fino alla scadenza naturale del Codice Padre.

### 1. DESCRIZIONE REPORT A

Il report di tipo A (formato CSV con separatore tra i campi “;”) rappresenta la situazione dei titoli di stato soggetti alla procedura di stripping che presentano un saldo Custody. Di seguito la descrizione dei campi che costituiscono la struttura del report giornaliero:

ID	CAMPO	CONTENUTO	FORMATO
1	Original Bond ISIN Code	Codice ISIN	12 a
2	Coupon Stripped ISIN Code	Codice ISIN	12 a
3	ISIN Code Description (original bond and/or coupon)	Descrizione ridotta codici ISIN	20 a
4	Original Bond Stripped Quantity	Valore Nominale Assoggettato a Stripping	17,2 n
5	Original Bond not yet Stripped Quantity	Valore Nominale Assoggettabile a Stripping	17,2 n
6	Stripped Coupon	Valore Nominale Cedola Stripping (campo segnato) = - stripping + unstripping	17,2 n
7	Interest Redemption Date	Data di pagamento cedola _ Stripping	yyyymmdd

## 2. DESCRIZIONE REPORT B

Il report di tipo B (formato CSV con separatore tra i campi ";") rappresenta la situazione dei titoli di stato che presentano un saldo Custody (tante colonne per quante sono le scadenze previste dal piano stripping) soggetti alla procedura di stripping (ogni file riporta la coppia di scadenze delle cedole es. 01/07 – 02/08) Se il valore del saldo custody non è presente la cella non sarà valorizzata). Di seguito la descrizione dei campi che costituiscono la struttura del report giornaliero:

ID	CAMPO	CONTENUTO	FORMATO
1	Issuer Code	Descrizione ridotta "MEF"	3a
2	Accounting Date	Data del movimento Stripping	yyyymmdd
3	Original Bond ISIN Code	Codice ISIN	12 a
4	Original Bond Maturity Date	Data di Scadenza finale del titolo PADRE	yyyymmdd
5	Original Bond Stripped Quantity	Valore Nominale Assoggettato a Stripping	17 n
6	Coupon Stripped ISIN Code	Codice ISIN	12 a
7	Principal Stripped Quantity	Valore Nominale Assoggettato a Stripping	17 n
8	Interest Redemption Date	Data di pagamento cedola _ Stripping	yyyymmdd
9	Coupon Stripped ISIN Code	Codice ISIN	12 a
10	Stripped Coupon Movement	Valore Nominale Cedola Stripping (campo segnato) = "- stripping" / "+ unstripping"	17 n

Di seguito un esempio esplicativo del file pubblicato sul sito MT:

1	2	3	4	5	6	7	8=I.R. DATE	9= ISIN	10= MOVEMENT
CODE	ACCOUNTING DATE	ORIGINAL BOND ISIN CODE	MATURITY DATE	ORIGINAL BOND QUANTITY	PRINCIPAL ISIN CODE	PRINCIPAL QUANTITY	INTEREST REDEMPTION DATE	INTEREST REDEMPTION DATE	INTEREST REDEMPTION DATE
							20120201	20120801	20130201
							IT0003204945	IT0003246409	IT0003246391
MEF	20110802	IT0004019581	20160801	35000000	IT0004038318	-35000000	-656250	-656250	-656250
MEF	20110802	IT0004286966	20390801	-13000000	IT0004288574	13000000	325000	325000	325000
MEF	20110802	IT0004361041	20180801	1000000	IT0004363450	-1000000	-22500	-22500	-22500

Si rimanda al seguente link per avere il piano dei Coupon Stripping completo:

<http://www.montetitoli.it/area-download/coupon-stripping/piano-stripping/pianostripping.htm>