

AVVISO n.2278	19 Febbraio 2010	MOT
----------------------	-------------------------	------------

Mittente del comunicato	:	Borsa Italiana
Societa' oggetto dell'Avviso	:	--
Oggetto	:	BTPI, OAT€i, GGB€i, BTAN€i, DBR€i, BUND€i e BOBL€i indicizzati all'indice HICP ex-tobacco

<i>Testo del comunicato</i>

Si veda allegato.

<i>Disposizioni della Borsa</i>
--

DISPOSIZIONI DI BORSA ITALIANA RELATIVE AI BTPi, OAT€, GGB€, BTAN€, DBR€, BUND€ e BOBL€ NEGOZIATI SUL MOT

Considerato che Eurostat comunicherà l'indice HICP ex-tobacco (Harmonised Indices of Consumer Price ex-tobacco), necessario per la determinazione dei Coefficienti di Indicizzazione dei BTPi (buoni del Tesoro poliennali indicizzati all'"Indice Eurostat"), relativo al mese di gennaio 2010, nel corso della mattinata del 26 febbraio p.v.;

Ritenuto che tale parametro risulta indispensabile per procedere al regolamento delle negoziazioni dei BTPi, effettuate sul mercato MOT, nella giornata del 25 febbraio p.v.;

Ritenuto inoltre che, essendo i BTPi negoziati su altri mercati regolamentati, appare opportuno un intervento omogeneo tra i diversi mercati;

Borsa Italiana dispone, relativamente ai BTPi di seguito elencati, che:

- le negoziazioni effettuate nella giornata del 25 febbraio p.v., saranno liquidate a T+2 e quindi, la data del relativo regolamento, sarà il 1° marzo 2010;

Borsa Italiana dispone inoltre che, per garantire omogeneità di trattamento nella gestione di titoli negoziati sul mercato MOT che presentano lo stesso Coefficiente di Indicizzazione legato all'indice HICP ex-tobacco e la medesima modalità di calcolo dei ratei di interesse, anche per le negoziazioni effettuate sul mercato nella medesima giornata del 25 febbraio p.v., aventi ad oggetto gli OAT€, GGB€, BTAN€, DBR€, BUND€ e BOBL€ di seguito elencati, la data di regolamento sarà a T+2 e dunque il 1° marzo 2010.

Borsa Italiana segnala inoltre che, al fine di gestire con l'indice definitivo HICP ex-tobacco il calcolo dei ratei e dei controvalori, **tutti i contratti conclusi sugli strumenti finanziari sotto indicati (BTPi, OAT€, GGB€, BTAN€, DBR€, BUND€ e BOBL€)** nella giornata del 26 febbraio p.v., e inoltrati al servizio X-TRM ai fini della consueta liquidazione a T+3, saranno elaborati dal sistema solo successivamente alla pubblicazione dell'indice definitivo prevista per la tarda mattinata del 26 febbraio p.v.

Per tale giornata si consiglia pertanto a tutti gli intermediari di richiedere l'informativa X-TRM, relativa ai contratti conclusi sugli strumenti finanziari in parola, solo dopo aver ricevuto dalla Monte Titoli, quale gestore del servizio X-TRM, specifica comunicazione.

L'intervento è finalizzato alla generazione di ratei e controvalori corretti per le negoziazioni effettuate nella medesima giornata del 26 febbraio 2010 e aventi data regolamento 3 marzo 2010.

Di seguito si riporta l'elenco dei titoli interessati alla presente disposizione, suddivisi per segmento di mercato:

DomesticMOT:

<i>Codice Isin</i>	<i>Descrizione Long</i>
IT0003625909	BTPI-15ST14 2,15%
IT0003745541	BTPI-15ST35 2,35%
IT0003805998	BTPI-15ST10 0,95%
IT0004085210	BTPI-15ST17 2,1%
IT0004216351	BTPI-15ST12 1,85%
IT0004243512	BTPI-15ST23 2,6%
IT0004380546	BTPI-15ST19 2,35%
IT0004545890	BTPI-15ST41 2,55%

EuroMOT:

<i>Codice Isin</i>	<i>Descrizione Long</i>
FR0000188013	OATEI LUG12 EUR 3
FR0000188799	OATEI LUG32 EUR 3,15
FR0010050559	OATEI LUG20 EUR 2,25
FR0010135525	OATEI LUG15 EUR 1,6
GR0338001531	GGBEI LUG25 EUR 2,9
FR0108664055	BTANEI LUG10EUR 1,25
DE0001030500	DBREI APR16 EUR 1,5
DE0001030526	BUNEI AP20 EUR 1,75
DE0001030518	BOBEI AP13 EUR 2,25