

Disposizione relativa agli strumenti finanziari indicizzati all'Euro zone Harmonised Indices of Consumer price ex-tobacco (HICP)

Considerato che l'Indice Armonizzato dei prezzi al Consumo HICP *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 2011 sarà pubblicato da Eurostat nel corso della mattinata del 28 febbraio p.v.;

Al fine di uniformare la modalità di regolamento dei titoli indicizzati all' HICP *ex-tobacco* agli altri mercati, EuroTLX dispone, relativamente ai BTPI di seguito elencati, che:

- le negoziazioni nella giornata del 25 febbraio saranno liquidate a T+2, e quindi con data di regolamento 1° marzo 2011;

EuroTLX dispone inoltre che, per garantire omogeneità di trattamento nella gestione dei titoli che presentano il medesimo coefficiente di Indicizzazione legato all'indice HICP *ex-tobacco* e la medesima modalità di calcolo dei ratei di interesse, anche per le negoziazioni effettuate nella stessa giornata del 25 febbraio p.v., aventi ad oggetto DBR€i, BUND€i, OATi di seguito elencati, la data di regolamento sarà a T+2 e dunque il 1° marzo 2011.

EuroTLX segnala inoltre che, al fine di permettere il calcolo dei controvalori e dei ratei utilizzando l'indice definitivo HICP *ex-tobacco* del mese di gennaio 2011, tutti i contratti conclusi sugli strumenti finanziari sotto indicati (BTPI, DBR€i, BUND€i, OATi) nella giornata del 28 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 28 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 28 febbraio 2011 e aventi data regolamento 3 marzo 2011.

Di seguito la lista dei titoli interessati dalla presente disposizione, negoziati su EuroTLX.

ISIN	TLX Code	Descrizione
DE0001030500	D03050	Germania DBR€i 1,50% 15.04.2016
DE0001030518	D03051	REPUBBLICA TEDESCA BUND€i 2.25% 15.04.2013
DE0001030526	D03052	REPUBBLICA TEDESCA BUND€i 1.75% 15.04.2020
FR0000188013	F18801	OATi 3% 25.07.12
FR0000188799	F18879	OATi 3,15% 25.07.32
FR0010050559	F05055	OATi 2,25% 25.07.20
FR0010135525	F13552	OATi 1,6% 25.07.15
FR0010447367	F44736	OATi 1,8% 25.07.2040
IT0004380546	PIST19	BTPi 2,35% 15.09.2019
IT0003625909	PIST14	BTPi 2,15% 15.09.14
IT0003745541	PIST35	BTPi 2,35% 15.09.35
IT0004085210	PIST17	BTPi 2,1% 15.09.17
IT0004216351	PIST12	BTPi 1,85% 15.09.2012
IT0004243512	PIST23	BTPi 2,6% 15.09.2023
IT0004545890	PIST41	BTPi 2.55% 15/09/2041
IT0004682107	PIST16	BTP€i 2,1% 15.09.2016
IT0004604671	PIST21	BTPi 2,1% 15.09.2021
FR0010899765	F89976	REPUBBLICA FRANCESE OAT€i 1.1% 25.07.2022

Ricordiamo infine che il file ANA_NextSettlementDate diffuso via ftp nelle giornate 24 e 25 febbraio 2011 non riporterà la data valuta corretta per gli strumenti in elenco.