

X-COM: Criteri di eleggibilità e parametri per la gestione del collateral

“BTP Italia Basket”

ISIN code: IT0005175028

In vigore dal 3 Aprile 2017

Nota: i valori di nuova introduzione oppure oggetto di modifica sono indicati in grassetto blu.

CRITERI DI ELEGGIBILITA'

a. Tipologie di strumenti finanziari accettati

Governativo	Sovranazionale	Corporate	Agency	Strutturato
X				

I titoli devono essere eleggibili per la Banca Centrale Europea e accentrabili in Monte Titoli.

b. Strumenti finanziari esclusi

Perpetui	Estendibili	Certificates	Infungibili
Esclusi	Esclusi	Esclusi	Esclusi

c. Paesi emittenti accettati per tipologia di titolo

Paese Emittente	Governativo	Sovranazionale	Corporate	Agency	Strutturato
Austria					
Belgio					
Finlandia					
Francia					
Germania					
Italia	X				
Irlanda					
Olanda					
Spagna					

d. Risk Indicator minimo per tipologia di titolo

I titoli devono avere almeno un rating (tra Fitch e S&P).

Governativo	Sovranazionale	Corporate	Agency	Strutturato
R10	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.

e. Divise di denominazione del titolo

Divisa
Euro

f. Scadenza massima

Scadenza massima degli strumenti finanziari	30 anni
---	---------

g. Prezzo di valorizzazione

Prezzi di mercato	Prezzi teorici
X	X

h. Quotation age massima

Quotation age massima del prezzo	5 giorni
----------------------------------	----------

i. Verifica close link

	SI/NO
1) Verifica assenza close link per i corporate bond	SI
2) Eleggibilità degli strumenti finanziari corporate in assenza di informazioni per il controllo close link	NO
3) Deroga al controllo close link per covered bond CRD compliant	SI

LIMITI DI CONCENTRAZIONE

a. Percentuale massima di ogni emissione (ISIN) sul valore nominale complessivo dell'emissione

40%

b. Percentuale massima di ogni emissione sul controvalore totale degli strumenti finanziari allocati a garanzia

100%

c. Percentuale massima per ogni combinazione «Tipologia titolo – Risk Indicator»

Risk Indicator	Governativo Sovranazionale	Corporate Agency	Strutturato
R1	100%	0%	0%
R2	100%	0%	0%
R3	100%	0%	0%
R4	100%	0%	0%
R5	100%	0%	0%
R6	100%	0%	0%
R7	100%	0%	0%
R8	100%	0%	0%
R9	100%	0%	0%
R10	100%	0%	0%

d. Percentuale massima per ogni combinazione «Tipologia titolo - Paese emittente»

Paese Emittente	Governativo Sovranazionale	Corporate Agency	Strutturato
Austria	0%	0%	0%
Belgio	0%	0%	0%
Finlandia	0%	0%	0%
Francia	0%	0%	0%
Germania	0%	0%	0%
Italia	100%	0%	0%
Irlanda	0%	0%	0%
Olanda	0%	0%	0%
Spagna	0%	0%	0%

*Per titoli governativi IT si intendono solo ed esclusivamente i BTP Italia.

e. Percentuale massima per Paese emittente

Paese Emittente	Percentuale
Austria	0%
Belgio	0%
Finlandia	0%
Francia	0%
Germania	0%
Italia	100%
Irlanda	0%
Olanda	0%
Spagna	0%

f. Percentuale massima per Tipologia titolo

Tipologia titolo	Percentuale
Governativo/sovranaZIONALE	100%
Corporate/Agency	0%
Strutturato	0%

Parametri di gestione del collaterale

a. Parametri per la gestione del processo di mark-to-market

Soglie per l'integrazione (Margin call) o la restituzione (Margin excess) delle Garanzie allocate

Percentuale di scostamento processo mark to market	Margin call	Margin excess
	0%	0,10%

b. Parametro per la definizione della soglia di sovra-collateralizzazione

Percentuale massima di eccedenza del valore delle garanzie trasferite rispetto all'importo da regolare

Soglia di sovra-collateralizzazione	0,10%
-------------------------------------	-------

* * *

Qualora modificati, i parametri si applicano anche alle posizioni aperte.