



Cassa di Compensazione e Garanzia SpA

Parametri vigenti per il comparto obbligazionario dal 16/04/2021

COUNTRY: ITALIA

Class	Duration	Unit	Margin Interval
I	(0-1]	months	0.15%
II	(1-3]	months	0.30%
III	(0,25-0,75]	years	0.90%
IV	(0,75-1,25]	years	1.70%
V	(1,25-2]	years	3.00%
VI	(2-3,25]	years	4.40%
VII	(3,25-4,75]	years	5.55%
VIII	(4,75-7]	years	5.90%
IX	(7-10]	years	6.40%
X	(10-15]	years	8.60%
XI	(15-35]	years	13.45%
XII	BTPI	BTPI	9.15%
XIII	CCT	CCT	5.60%

	I	II	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI
I	5% 1										
II		40% 2	20% 14								
III		20% 14	50% 3	25% 17							
IV			25% 17	75% 4	40% 23	25% 24					
V				40% 23	65% 5	45% 29	30% 30				
VI				25% 24	45% 29	70% 6	50% 35	35% 36	25% 37		
VII					30% 30	50% 35	75% 7	55% 40	40% 41	25% 42	
VIII						35% 36	55% 40	70% 8	55% 44	40% 45	
IX						25% 37	40% 41	55% 44	75% 9	55% 47	25% 48
X							25% 42	40% 45	55% 47	75% 10	40% 49
XI									25% 48	40% 49	55% 11

Percentuale di maggiorazione per transazioni in fail	10.00 %
--	---------

Nota: i valori di nuova introduzione oppure oggetto di modifica sono evidenziati in grassetto

Cassa di Compensazione e Garanzia SpA

Parametri vigenti per il comparto obbligazionario dal 16/04/2021

COUNTRY: SPAGNA

Class	Duration	Unit	Margin Interval
I SPA	(0-1]	months	0.15%
II SPA	(1-3]	months	0.20%
III SPA	(0,25-0,75]	years	0.40%
IV SPA	(0,75-1,25]	years	0.75%
V SPA	(1,25-2]	years	1.70%
VI SPA	(2-3,25]	years	2.40%
VII SPA	(3,25-4,75]	years	3.00%
VIII SPA	(4,75-7]	years	4.40%
IX SPA	(7-10]	years	5.75%
X SPA	(10-15]	years	8.80%
XI SPA	(15-30]	years	17.40%
XII SPA	SIL	months	13.05%

	I SPA	II SPA	III SPA	IV SPA	V SPA	VI SPA	VII SPA	VIII SPA	IX SPA	X SPA	XI SPA
I SPA	0% 1										
II SPA		30% 2									
III SPA			45% 3	40% 16							
IV SPA			40% 16	80% 4	35% 22						
V SPA				35% 22	65% 5	45% 28	30% 29				
VI SPA					45% 28	70% 6	50% 34	30% 35			
VII SPA					30% 29	50% 34	75% 7	45% 39	35% 40	20% 41	
VIII SPA						30% 35	45% 39	65% 8	50% 43	35% 44	
IX SPA							35% 40	50% 43	70% 9	50% 46	25% 47
X SPA							20% 41	35% 44	50% 46	80% 10	45% 48
XI SPA									25% 47	45% 48	70% 11

Percentuale di maggiorazione per transazioni in fail	10.00 %
--	---------

Nota: i valori di nuova introduzione oppure oggetto di modifica sono evidenziati in grassetto



Cassa di Compensazione e Garanzia SpA

Parametri vigenti per il comparto obbligazionario dal 16/04/2021

COUNTRY: IRLANDA

Class	Duration	Unit	Margin Interval
I IRL	(0-1]	months	0.20%
II IRL	(1-3]	months	0.50%
III IRL	(0,25-0,75]	years	0.60%
IV IRL	(0,75-1,25]	years	1.65%
V IRL	(1,25-2]	years	3.50%
VI IRL	(2-3,25]	years	4.55%
VII IRL	(3,25-4,75]	years	5.15%
VIII IRL	(4,75-7]	years	5.95%
IX IRL	(7-10]	years	6.95%
X IRL	(10-15]	years	12.00%
XI IRL	(15-30]	years	19.90%

	I IRL	II IRL	III IRL	IV IRL	V IRL	VI IRL	VII IRL	VIII IRL	IX IRL	X IRL	XI IRL
I IRL	0% 1										
II IRL		30% 2									
III IRL			45% 3								
IV IRL				80% 4	45% 20	30% 21					
V IRL				45% 20	65% 5	45% 26	30% 27				
VI IRL				30% 21	45% 26	70% 6	50% 32	30% 33			
VII IRL					30% 27	50% 32	75% 7	45% 37	35% 38	20% 39	
VIII IRL						30% 33	45% 37	65% 8	50% 41	35% 42	
IX IRL							35% 38	50% 41	70% 9	50% 44	25% 45
X IRL							20% 39	35% 42	50% 44	80% 10	45% 46
XI IRL									25% 45	45% 46	70% 11

Percentuale di maggiorazione per transazioni in fail

Nota: i valori di nuova introduzione oppure oggetto di modifica sono evidenziati in grassetto



Cassa di Compensazione e Garanzia SpA

Parametri vigenti per il comparto obbligazionario dal 16/04/2021

COUNTRY: PORTOGALLO

Class	Duration	Unit	Margin Interval	I POR	II POR	III POR	IV POR	V POR	VI POR	VII POR	VIII POR	IX POR	X POR	XI POR
I POR	(0-1]	months	0.30%	0% 1										
II POR	(1-3]	months	0.35%		30% 2									
III POR	(0,25-0,75]	years	0.70%			45% 3	30% 15							
IV POR	(0,75-1,25]	years	2.10%			30% 15	80% 4	40% 21	30% 22					
V POR	(1,25-2]	years	5.15%				40% 21	65% 5	45% 27	30% 28				
VI POR	(2-3,25]	years	7.55%				30% 22	45% 27	70% 6	50% 33	30% 34			
VII POR	(3,25-4,75]	years	7.70%					30% 28	50% 33	75% 7	45% 38	35% 39	20% 40	
VIII POR	(4,75-7]	years	9.45%						30% 34	45% 38	65% 8	50% 42	35% 43	
IX POR	(7-10]	years	9.25%							35% 39	50% 42	70% 9	50% 45	25% 46
X POR	(10-15]	years	10.00%							20% 40	35% 43	50% 45	80% 10	45% 47
XI POR	(15-30]	years	20.50%									25% 46	45% 47	65% 11

Percentuale di maggiorazione per transazioni in fail	10.00 %
--	---------

Nota: i valori di nuova introduzione oppure oggetto di modifica sono evidenziati in grassetto