

# Market Notice – Testing Plan

June 8 maggio 2017

## Test Integration to execution of the Buy-In procedure

### Seque versione in italiano

Dear Customers, this communication follows the Market Notice dated 31 May 2017.

- This to remind you that the test environment is available starting from today
- To inform you that CC&G, upon Members'<sup>1</sup> request via the attached form, will proceed to insert unsettled positions (i.e. fails) in delivery/receipt to/from CC&G, as per Table 1, on behalf of its Members, in order to test reports and data files generation related to the end of validity date extension and to the buy in triggering procedure that foresees the forced underlying securities<sup>2</sup> purchase, these information will be available for Members' consulting after the CC&G "night batch"
- To provide in Table 2 further details in relation to the reports and datafiles

Table 1: Fails input by CC&G on behalf of Members that required this service

Insertion date	End of validity date	Isin	Quantity	in malis*	in bonis*	test case	new end of validity date	reports**
14/6/2017	14/6/2017	IT0005252207	1.000.000	c/t	c/p	5 days delivery postponement	21/6/2017	RP-ME40/ME42 DataFile D45A
14/6/2017	14/6/2017	XS1017833242	1.000.000	c/t	c/p	see above	21/6/2017	RP-ME41/ME43 DataFile D45A
15/6/2017	15/6/2017	IT0005252207	500.000	c/t	c/p	See above	21/6/2017	RP-ME40/ME42 DataFile D45A
15/6/2017	15/6/2017	XS1017833242	500.000	c/t	c/p	FIFO alteration delivery postponement	16/6/2017	RP-ME41/ME43 DataFile D45A
16/6/2017	16/6/2017	IT0004760648	500.000	c/t	c/p	Ordinary execution with the securities purchase by CC&G	NA	RP-ME44/ME46 DataFile D25B
16/6/2017	16/6/2017	XS1017833242	500.000	c/t	c/p	see above. It refers to the failure previously postponed by FIFO alteration	NA	RP-ME45/ME47 DataFile D25B

\* Fails will be entered in third party account (delivery side) proprietary account ( receipt side) of the Member that required it

\*\* Please note that the above mentioned reports/data files could also contain further fails in addition to those listed in the table, linked to the activities done by the Member in test environment

<sup>1</sup> The General Members have to specify which indirect Members or which account AOA e ISA should be involved in the testing .

<sup>2</sup> It is mandatory to have the CDS and ICWS accounts to access the testing environment and FTP connection to receive the repots and the datafile.



# Market Notice – Testing Plan

June 8 maggio 2017

Table 2: Reports e data files

Report/Datafile*	Section	Recipient	Instance
RP-ME40/	Shares & Equity derivative	Member/ Settlement agent	Fails at the end of validity date in that day or in the previous days that still continue to recycle
RP-ME41	Bond & ICSD Bond	Direct Member**/ Settlement agent	idem
RP-ME42/	Shares & Equity derivative	Member*/ Settlement agent	idem
RP-ME43	Bond & ICSD Bond	Direct Member**/ Settlement agent	idem
DataFile D45A	All sections	Member/ Settlement agent	idem
RP-ME44/	Shares & Equity derivative	Member/ Settlement agent	Fails that reached the last recycling date, hence the day after CC& will proceed to purchase the securities to the detriment of the in malis Member
RP-ME45	Bond & ICSD Bond	Direct Member**/ Settlement agent	Idem
RP-ME46	Shares & Equity derivative	Member/ Settlement agent	idem
RP-ME47/	Bond & ICSD Bond	Direct Member**/ Settlement agent	idem
DataFile D25B	All sections	Member/ Settlement agent	idem

\* An example of the reports and of the data files structure is reported on the technical manual available on CC&G website

\*\* The report shows the fails related to all securities account of the direct Member: proprietary account, third party account, proprietary and third party accounts of indirect Members and potential additional account third party omnibus account and third party segregated account

## Contacts:

### Membership

Tel. +39.02.7242.6501

e-mail: [client.services@lseg.com](mailto:client.services@lseg.com)

### Operations

Tel. +39.06.32395.303

e-mail: [clearing.settlement@ccg.com](mailto:clearing.settlement@ccg.com)

### Post Trade Sales

Tel. +39 02 33635283

e-mail: [pt.sales@lseg](mailto:pt.sales@lseg)

### Helpdesk

Tel. +39.06.32395.210

e-mail: [helpdesk@ccg.it](mailto:helpdesk@ccg.it) tel. 06 32 395 210



**London**

Stock Exchange Group



# Market Notice - Piano di collaudo

7 giugno 8 maggio 2017

## Integrazione del test sull'Esecuzione della Procedura di Buy-In

Gentili Clienti, si fa seguito al Market Notice del 31 maggio u.s..

- per ricordare che da oggi è disponibile l'ambiente di test;
- segnalare altresì che CC&G, per i Partecipanti<sup>5</sup> che ne facciano richiesta inviando il modulo allegato alla presente, provvederà ad inserire le posizioni contrattuali non regolate tanto in consegna a CC&G quanto in ritiro da CC&G (c.d. fails) di cui alla tabella 1 per testare la generazione dei report e datafile relativi alla proroga o avvio dell'esecuzione con acquisto forzoso dei titoli sottostanti<sup>6</sup>, che saranno consultabili per i Partecipanti dopo il "batch notturno" di CC&G;
- fornire nella tabella 2 ulteriori dettagli sui report e datafile.

Tabella1: Inserimento dei fails da parte di CC&G per conto dei Partecipanti che ne facciano richiesta

data inserimento	data fine validità	isin titolo	quantità titolo	in malis* c/t	in bonis* c/p	test case	nuova data fine validità	reports**
14/6/2017	14/6/2017	IT0005252207	1.000.000	c/t	c/p	Posticipo consegna 5gg	21/6/2017	RP-ME40/ME42 DataFile D45A
14/6/2017	14/6/2017	XS1017833242	1.000.000	c/t	c/p	come sopra	21/6/2017	RP-ME41/ME43 DataFile D45A
15/6/2017	15/6/2017	IT0005252207	500.000	c/t	c/p	come sopra	21/6/2017	RP-ME40/ME42 DataFile D45A
15/6/2017	15/6/2017	XS1017833242	500.000	c/t	c/p	Posticipo consegna alterazione FIFO	16/6/2017	RP-ME41/ME43 DataFile D45A
16/6/2017	16/6/2017	IT0004760648	500.000	c/t	c/p	Esecuzione ordinaria con acquisto titoli da parte di CC&G	NA	RP-ME44/ME46 DataFile D25B
16/6/2017	16/6/2017	XS1017833242	500.000	c/t	c/p	come sopra riferito al fail precedentemente posticipato per alterazione il FIFO	NA	RP-ME45/ME47 DataFile D25B

\* I fails verranno inseriti in capo al conto terzi (lato consegna) e conto proprio (lato ritiro) del partecipante che ha fatto richiesta.

\*\* Si segnala che i suddetti report/datafile potrebbero contenere anche ulteriori fails oltre a quelli di cui in tabella, legati all'operatività svolta dal partecipante in ambiente di test.

<sup>5</sup> I partecipanti generali indicano nella richiesta i partecipanti indiretti o i conti AOA e ISA che vogliono includere nel test.

<sup>6</sup> Resta ferma la necessità di avere le utenze per accedere all'ambiente CDS di ICWS e del server FTP per la ricezione dei report e datafile.



**London**  
Stock Exchange Group

# Market Notice - Piano di collaudo

7 giugno 2017

Tabella 2: Report e datafile

report/datafile*	Comparti	Destinatario	fattispecie
RP-ME40/	Azionario & Derivati Azionari	Partecipante/ Agente Regolamento	fails giunti a fine validità nel giorno o nei giorni precedenti che il giorno successivo continueranno a riciclare
RP-ME41	Obbligazionario & Obbligazionario ICSD	Partecipante Diretto**/ Agente Regolamento	idem
RP-ME42/	Azionario & Derivati Azionari	Partecipante*/ Agente Regolamento	idem
RP-ME43	Obbligazionario & Obbligazionario ICSD	Partecipante Diretto**/ Agente Regolamento	idem
DataFile D45A	tutti i Comparti	Partecipante/Agente Regolamento	di idem
RP-ME44/	Azionario & Derivati Azionari	Partecipante/ Agente Regolamento	fails giunti a fine validità nel giorno che non ricicleranno più in quanto CC&G il giorno successivo acquisterà i titoli in danno del partecipante in malis.
RP-ME45	Obbligazionario & Obbligazionario ICSD	Partecipante Diretto**/ Agente Regolamento	idem
RP-ME46	Azionario & Derivati Azionari	Partecipante/ Agente Regolamento	idem
RP-ME47/	Obbligazionario & Obbligazionario ICSD	Partecipante Diretto**/ Agente Regolamento	idem
DataFile D25B	tutti i Comparti	Partecipante/Agente Regolamento	di idem

\*I sample dei report e la struttura del datafile sono illustrati nel manuale tecnico disponibile sul sito di CC&G

\*\*Il report riporta i fails riferiti a tutti i conti posizioni del Partecipante Diretto: conto proprio, conto terzi, conti proprio e terzi dei partecipanti indiretti, eventuali conti addizionali terzi omnibus e terzi segregati

## Contatti:

### Membership

Tel. +39.02.7242.6501

e-mail: [client.services@lseg.com](mailto:client.services@lseg.com)

### Operations

Tel. +39.06.32395.303

e-mail: [clearing.settlement@ccg.com](mailto:clearing.settlement@ccg.com)

### Post Trade Sales

Tel. +39 02 33635283

e-mail: [pt.sales@lseg](mailto:pt.sales@lseg)

### Helpdesk

Tel. +39.06.32395.210

e-mail: [helpdesk@ccg.it](mailto:helpdesk@ccg.it) tel. 06 32 395 210



**London**  
Stock Exchange Group

