
CC&G Risk Notice

8 Febbraio 2021

RN_01/2021

Richiesta dati in materia di esposizioni verso le CCP

All'attenzione di:

Partecipanti Diretti – Ufficio Risk Management

Priorità:

media

Argomento:

Richiesta dati in materia di esposizioni verso le CCP

Gentile Cliente,

In linea con le raccomandazioni dell'ESMA in materia di requisiti di partecipazione alla CCP, CC&G richiede ai propri Partecipanti la segnalazione dei dati relativi alle esposizioni aggregate verso tutte le Controparti Centrali alle quali essi siano aderenti diretti, ai fini della valutazione dei requisiti di partecipazione di cui all'art. 37 EMIR. Tali dati, richiesti con frequenza annuale, devono essere rappresentativi delle esposizioni al 31 dicembre dell'anno concluso e dovranno essere inseriti all'interno del Portale di Membership nella sezione "Membership to other CCPs / Annual Exposure to all CCPs" compilando i campi 'Date', 'Currency', 'Pre-funded resources' e 'Non Pre-funded resources' entro il 1 marzo 2021.

In particolare, l'ESMA raccomanda che le Autorità competenti si assicurino che le CCP vigilate considerino, in tema di requisiti di partecipazione, le eventuali perdite verso le quali i partecipanti si trovino esposti in ragione della partecipazione in molteplici CCP, considerando anche le potenziali perdite di risorse mutualizzate prefinanziate e non prefinanziate, sulla base dei dati che dovranno essere forniti dai partecipanti stessi.

CC&G Risk Notice

8 Febbraio 2021

RN_01/2021

Note per la compilazione:

Generale

- La data da indicare corrisponde all'ultimo giorno lavorativo dello scorso anno (es. 31/12/2020).
- La valuta utilizzata per riportare i dati è quella selezionata dal partecipante. Nel caso in cui la valuta utilizzata fosse diversa dall'Euro il sistema riporterà automaticamente il relativo controvalore.
- La presente richiesta di dati avverrà con cadenza annuale. I dati dovranno rappresentare la situazione al 31 dicembre dell'anno antecedente alla compilazione (ad es. per una richiesta nel 2021 i dati riportati rappresenteranno la situazione al 31 dicembre 2020). I partecipanti dovranno compilare il Portale di Membership entro il 1 marzo 2021.
- *'Esposizione'* indica l'ammontare delle perdite verso le quali un partecipante si trovi esposto in ragione della sua partecipazione in *tutte* le CCP inclusa CC&G, delle quali il partecipante sia membro a livello globale (non solo europeo).
- *'Partecipante'* indica la persona giuridica partecipante diretto alla CCP, esclusi i soggetti ad essa affiliati

Pre-funded resources

- Indica l'ammontare complessivo delle contribuzioni al Default Fund effettuate dal Partecipante presso tutte le CCP di cui sia membro alla data di riferimento.

Nel caso in cui il Partecipante aderisca solo a CC&G, dovrà essere indicato un ammontare pari al valore precompilato sul Portale di Membership nel campo 'Pre-funded resources' sulla riga di CC&G.

Non Pre-funded resources

- Indica l'ammontare complessivo delle potenziali richieste di versamento verso le quali il partecipante risulta vincolato come da relativo regolamento di ciascuna CCP a cui partecipa (c. d. assessment power).
- Presupposti:
 - In caso di evento di default singolo.
 - In caso di richieste illimitate, includere l'importo equivalente a tre (3) richieste di versamento di risorse addizionali, salvo diversa indicazione da parte della CCP (ad es. disposizioni che impongono una (1) richiesta di versamento di risorse addizionali nel caso in cui il partecipante receda dalla CCP).
 - Nei riguardi delle CCP considerate a livello globale (non solo CCP europee)

Nel caso in cui il Partecipante aderisca solo a CC&G, dovrà essere indicato un ammontare pari al valore precompilato sul Portale di Membership nel campo 'Non pre-funded resources' alla riga di CC&G.

Tale somma è stata ricavata secondo la seguente metodologia: 1,5 volte il contributo al Default Fund per tutti i comparti, come da Regolamento di CC&G, Articolo B.6.2.3, lettera f).

CC&G Risk Notice

8 Febbraio 2021
RN_01/2021

Esempio in caso di adesione solo presso CC&G.

Pre-funded resources	Non pre-funded resources
€ 100 (quota di contribuzione al 31/12)	€ 150 (quota di contribuzione al 31/12 * 1,5)

Per eventuali ulteriori informazioni, si prega di contattare i seguenti uffici:

Ufficio Risk Management

E-mail: rm.group@lseg.com

Membership

E-mail: client.services@lseg.com