

# Avviso

3 Gennaio 2014

- **Modifica dell'ammontare del Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia;**
- **Variazione delle Quote di Contribuzione ai Default Fund.**

Egredi Signori / Gentili Signore,

Si informa che a partire dal 7 Gennaio p.v., l'ammontare del Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia passerà da € 35 milioni a € 55 milioni.

Dalla stessa giornata, al menu Default Fund della ICWS e per il tramite del messaggio M01 sulla RNI, sarà segnalata la variazione delle Quote di Contribuzione dovute a tutti i Default Fund.

I Partecipanti debitori o i relativi Agenti di Regolamento dovranno rendere capiente il proprio Conto PM nel Sistema TARGET2 affinché CC&G possa provvedere all'addebito diretto delle somme dovute<sup>1</sup>. Il periodo di addebito inizierà alle ore 9:00 e terminerà alle ore 9:30 del 7 Gennaio p.v.<sup>2</sup>

CC&G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento l'8 Gennaio p.v.<sup>1</sup>

Si ricorda a tal fine che le causali di pagamento utilizzate da CC&G saranno:

- **BOR-MDF**, per il Default Fund relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari;

- **BOR-MEL**, per il Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia;
- **BOR-MMT**, per il Default Fund relativo ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD.

Sul sito web di CC&G [www.ccg.it](http://www.ccg.it) è inoltre disponibile la seguente documentazione:

- alla sezione "Gestione del Rischio - Parametri Default Fund", gli ammontari complessivi dei Default Fund e gli altri parametri utilizzati per il calcolo delle Quote di Contribuzione;
- alla sezione "In evidenza" della Homepage, gli avvisi relativi alle eventuali variazioni dei parametri;
- alla sezione "Gestione del Rischio - Documentazione", le modalità di calcolo delle Quote di Contribuzione.

Gli uffici della scrivente sono a disposizione per ogni eventuale chiarimento (tel. 06 32395 321).

Cordiali saluti.

Cassa di Compensazione e Garanzia S.p.A.

<sup>1</sup> Utilizzando la procedura ancillare n.3 (c.d. Bilateral Settlement).

<sup>2</sup> Gli importi in addebito saranno notificati da CC&G al Partecipante Diretto o al relativo Agente di Regolamento mediante il "preavviso di pagamento" inviato nel Sistema TARGET2 via ICM alle ore 7:45 e, qualora attivata, tramite la "Rendicontazione giornaliera dei pagamenti" (messaggi M03 via RNI e messaggi MT298 via SWIFT).

