
Market Notice

30 Maggio 2014

- **Modifica dell'ammontare dei Default Fund relativi al Comparto Derivati dell'Energia e ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD;**
- **Variazione delle Quote di Contribuzione al Default Fund.**

Egregi Signori / Gentili Signore,

a partire dal **4 Giugno p.v.**, l'ammontare del Default Fund relativo al Comparto Derivati dell'Energia passerà da **€ 45 milioni** a **€ 40 milioni**, mentre quello dei Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD passerà da **€ 2.000 milioni** a **1.800 milioni**.

Dalla stessa giornata, nel 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 dovute¹. Il periodo di addebito inizierà alle ore 9:00 e terminerà alle ore 9:30 del **4 Giugno p.v.**²

CC&G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento il **5 Giugnop.v.**¹

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

- **BOR-MDF**, per il Default Fund relativo al 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 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.

¹ Utilizzando la procedura ancillare n.3 (c.d. Bilateral Settlement).

² 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).

