
Market Notice

21 Luglio 2014

Modifica dell'ammontare del Default Fund relativo ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD

Egregi Signori / Gentili Signore,

a partire dal **23 Luglio p.v.**, l'ammontare del Default Fund relativo ai Comparti Obbligazionario e Obbligazionario ICSD passerà da € **1.900 milioni** a **1.600 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 al Default Fund in oggetto.

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 **23 Luglio p.v.**²

CC&G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento il **24 Luglio p.v.**¹

Si ricorda a tal fine che la causale di pagamento utilizzata da CC&G sarà **BOR-MMT**.

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.

Cassa di Compensazione e Garanzia

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).

