

---

# Market Notice

23 Ottobre 2015

## Modifica dell'ammontare del Default Fund relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari

---

Egredi Signori / Gentili Signore,

a partire dal **26 Ottobre**, l'ammontare del Default Fund relativo ai Comparti Azionario e Derivati Azionari passerà da € 1.600 milioni a € 1.750 milioni.

Nella stessa giornata:

- nel menu Default Fund della ICWS e per il tramite del messaggio M01 sulla RNI sarà segnalata la variazione della Quota di Contribuzione dovuta 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 dovute<sup>1</sup> (il periodo di addebito inizierà alle ore 9:00 e terminerà alle ore 9:30<sup>2</sup>);
- CC&G accrediterà i Conti PM dei Partecipanti creditori o dei relativi Agenti di Regolamento.<sup>1</sup>

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

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

- alla sezione "Risk Management - Default Fund Parameters", gli ammontari complessivi dei Default Fund e gli altri parametri utilizzati per il calcolo delle Quote di Contribuzione;
- alla sezione "Risk Management", 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).

