

CONVEGNO DI MILANO

31 MARZO 2017



Gruppo Cassa Centrale Banca

CREDITO COOPERATIVO ITALIANO

AREE PROGETTUALI: LA SQUADRA

Tesoreria

Thomas Franchini

Responsabile Tesoreria - CCB

I VANTAGGI DI UNA TESORERIA DI GRUPPO

Liquidità

- ✓ **Efficientamento dell'equilibrio di liquidità** (LCR e NSFR)
- ✓ **Migliori condizioni economiche con controparti esterne:** impiego liquidità e riduzione dei bisogni complessivi di raccolta
- ✓ **Accentramento e flessibilità della gestione del collateral,** maggiori strategie disponibili

Funding

- ✓ **Agevolazione dell'accesso alle fonti di funding** di mercati nazionali ed internazionali
- ✓ **Ottimizzazione sfruttando il merito di credito e minimizzando il costo della raccolta**

Presidi di tesoreria

- ✓ **Accentramento del monitoraggio della liquidità**
- ✓ **Flusso informativo in tempo reale** grazie all'integrazione con le società del network
- ✓ **Maggiore controllo dei profili di rischio** delle BCC/CR

PIENO ACCESSO AL FUNDING PER LE BCC/CR

CCB garantisce già da oggi l'accesso al funding interbancario domestico e internazionale, sta introducendo nuovi canali e rafforzando i presidi di Tesoreria

✓ Accesso diretto/indiretto alle **fonti di funding**

Prossimo focus

✓ Introduzione del **Conto Collateral**

✓ Attivazione di nuove infrastrutture per una sempre più flessibile gestione del collateral e monitoraggio continuo delle opportunità offerte dal mercato

✓ **Servizi FX:**

- Funding di valuta
- Negoziazione e copertura del rischio di cambio

FOCUS SUL CONTO COLLATERAL

Le forme tecniche

- ✓ Finanziamenti garantiti secondo le **modalità delle operazioni di mercato aperto della BCE**
- ✓ Finanziamenti **garantiti sulle scadenze e alle condizioni del mercato repo**
- ✓ Finanziamenti garantiti **overnight in chiusura di giornata lavorativa in presenza di saldi liquidi a debito sul conto corrente interbancario**
- ✓ **Unico pool di garanzia di titoli «eligible»** presso la BCE per tutte le forme tecniche di finanziamento garantito (BCE, repo, conto corrente)

Conto Collateral



CONTO COLLATERAL

Banca: 12345 - CASSA RURALE / BANCA DI CREDITO COOPERATIVO
Situazione al: 14/02/2017 08:32:10

Intestazione e data/ora aggiornamento

RIEPILOGO SITUAZIONE ATTUALE

Totale linee accordate:	23.050.000,00
Totale Cdv (ital):	10.825.813,36
Totale utilizzo garantito linee:	6.660.000,00
Margine Collaterale:	4.975.813,36
% Over Collaterale:	88,86%

Riepilogo delle Garanzie e del valore utilizzato

TITOLI A GARANZIA SUL CONTO COLLATERAL

ISIN	DESCRIZIONE	NOMINALE	NOMINALE BLOCCATO	SCADENZA	HC	HC BCE	DCB	PREZZO VALUTAZIONE (PTQ)	DTV
Elenco e valore delle Garanzie utilizzate									
IT000783274	BTP-01MG17 4,75% 12/17	145.000,00	0,00	31/05/2017	0,50	0,00		82,68780	134.387,31
IT000408000	BTP-EU-160M17 7% EM-11	3.949.000,00	40.000,00	15/09/2017	0,50	0,00		91,82919	5.447.555,35
IT000408070	BTP-01NV17 3,25% 12/17	1.000,00	0,00	31/11/2017	1,20	0,00		93,31783	933,18
IT000427303	BTP-01FB16 4,50% 07/16	3.443.000,00	0,00	31/03/2016	0,50	0,00		93,18620	3.299.280,60
IT000407843	BTP-01GN13 3,80% 03/13	1.000,00	0,00	31/03/2013	0,50	0,00		91,83352	1.521.091,64
IT000363104	BTP-01AG13 4,50% 08/13 E3	1.000,00	0,00	31/08/2013	0,50	0,00		95,14655	95.145,65
IT000501233	BTP-ITALIA-23AP10 5,48%	1.000,00	0,00	31/03/2010	0,50	0,00		94,32430	48.119,30
TOTALE									10.026.013,96

Se ci sono titoli vincolati fino a data futura è possibile consultare il dettaglio

OPERAZIONI GARANTITE DA CONTO COLLATERAL

NUMERO	TIPO	IMPORTO	PARTENZA	SCADENZA	TASSO
000	Elenco dei Finanziamenti che impegnano il Conto Collaterale		2017	22/02/2017	0,02
00011253	MIO Mensile	4.100.000,00	23/12/2016	27/04/2017	-0,20

LINEE DI CREDITO ACCORDATE

NUMERO	DESCRIZIONE	IMPORTO ACCORDATO	UTILIZZATO CONTABILE
600	Elenco delle Linee di Finanziamento concesse	0,00	0,00
601		0,00	4.100.000,00
602	FIDO DINAMICO A STE BCE	13.000.000,00	1.200.000,00
TOTALE			5.300.000,00

Perno per l'accesso ai mercati per le BCC/CR attraverso la tesoreria di gruppo