

**Informazioni utili.**

0122006

 Codice LEI Banca:  
2W8N8UU78PMDQKZENC08

 Identificativo Cliente (NDG/NSG):  
5261700029000

 Codice LEI Cliente:  
NON DISPONIBILE

 AMMINISTRAZIONE PROVINCIALE  
DI IMPERIA  
VIALE GIACOMO MATTEOTTI,147  
18100 IMPERIA IM

Il presente documento costituisce **Rendicontazione periodica** dei Contratti in strumenti finanziari derivati in essere tra il Cliente e la Banca, come definiti dalla Direttiva 2014/65/UE del Parlamento europeo e del Consiglio del 15 maggio 2014 ("MiFID II") e nell'Allegato I, sezione C, punti da 4 a 10 del Decreto Legislativo 24 febbraio 1998, n. 58 non negoziati in una sede di negoziazione.

**Contratti su tassi di interesse**

Tipologia Contratto	Numero Contratto	Divisa	Data di Stipulazione	Data di Scadenza	Capitale di Riferimento	Capitale in vita	Mark to Market (€)	Presunto Intraito minimo/Esborso massimo in caso di smobilizzo (€)
Interest Rate Swap	13078991	EUR	06.03.2007	31.12.2030	8.727.390 €	6.685.860 €	-3.499.768	-3.587.546
EURBO 6M	Receive	EUR			8.727.390	6.685.860		
EURBO 6M	Pay	EUR			8.727.390	6.685.860		
Codice UTI: CAR07620140203204017476								

**Avvertenze.**

Tutti i termini riportati nel presente documento, se non diversamente specificato qui di seguito, hanno il significato a ciascuno di essi attribuito nella documentazione contrattuale sottoscritta.

Per le sole Opzioni su Valuta (estera), con **Capitale di Riferimento** si intende l'ammontare della Valuta dell'Opzione.

Tutte le controvalorizzazioni in Euro degli importi espressi in valuta estera si intendono effettuate al cambio della data cui si riferisce il presente rendiconto.

Con **Capitale in vita** si intende il *Capitale di Riferimento*, diminuito fino alla data cui si riferisce il presente rendiconto:

- delle eventuali quote di ammortamento in caso di Contratti su tassi d'interesse;
- a seguito di esercizi parziali per i Contratti su valute;
- delle eventuali quote di ammortamento in caso di Contratti su commodity.

Il **Mark to Market** è il valore corrente di mercato inteso quale valore attualizzato dei flussi futuri attesi di ciascun Contratto calcolato alla data cui si riferisce il presente rendiconto, il cui segno positivo (+) o negativo (-) è da riferirsi alla posizione del Cliente. La Banca provvede a determinare il valore corrente di mercato di ciascun Contratto

 5261700029000  
P  
SROTHM 23

secondo criteri generalmente accolti nel mercato medesimo. Al riguardo la Banca dichiara di essere dotata di strumenti di determinazione del Mark to Market basati su solide metodologie riconosciute e diffuse sul mercato, proporzionate alla complessità del prodotto e coerenti con i criteri utilizzati per la valutazione del portafoglio di strumenti finanziari di proprietà della Banca, per la redazione del bilancio o per finalità di gestione del rischio.

Il **Mark to Market** potrebbe differire da altre valutazioni basate su diverse metodologie di calcolo e il suo utilizzo, per finalità diverse da quelle della presente comunicazione, è effettuato sotto l'esclusiva responsabilità del Cliente. Nella lettura del Mark to Market si dovrà inoltre considerare che il suo valore:

- varia di continuo in funzione della variazione dei tassi di interesse, prezzi e cambi e di altri parametri economici;
- non riflette necessariamente le differenze esistenti tra lettera e denaro, trattandosi in genere di una media di mercato;
- si riferisce ad un preciso momento temporale;
- non costituisce proposta di conclusione di contratto, né termini negoziali secondo cui la Banca concluderebbe una operazione.

**Il valore di Mark to Market riportato nel presente documento non ricomprende il rischio di credito della Banca e del Cliente e il costo della liquidità.**

Si ricorda che ai fini dell'adempimento all'obbligo di Segnalazione dei Contratti e di qualsiasi modifica o cessazione dei medesimi a un Repertorio di Dati sulle negoziazioni ("*Trade Repository*") l'identificazione dei clienti/controparti persone giuridiche può avvenire esclusivamente mediante il LEI ("*Legal Entity Identifier*") e che pertanto deve essere comunicato tempestivamente alla Banca, rinnovato e mantenuto valido nel corso del tempo.

Il LEI è un codice identificativo univoco ed esclusivo dei soggetti giuridici impegnati nelle transazioni finanziarie. Qualora non avesse già provveduto, La invitiamo a contattare una qualsiasi LOU, la cui lista è consultabile all'indirizzo <https://www.gleif.org/en/about-lei/how-to-get-an-lei-find-lei-issuing-organizations>. Per le società residenti in Italia il codice LEI può essere fornito da Unioncamere all'indirizzo <https://lei-italy.infocamere.it/leii/Home.action>.

Il presente rendiconto:

- non costituisce una proposta della Banca di estinzione anticipata;
- contiene l'indicazione del "Presunto Introito minimo/Esborso massimo in caso di smobilizzo" alla data cui si riferisce: vale a dire l'ammontare minimo/massimo, comprensivo degli oneri a carico del Cliente, che il Cliente stesso avrebbe potuto incassare/dovuto pagare qualora il Cliente e la Banca si fossero accordati per estinguere anticipatamente ciascun Contratto individuato nel presente documento alla data cui si riferisce il medesimo. **Il valore indicato non ricomprende il rischio di credito della Banca e del Cliente e il costo della liquidità.**

Le condizioni di mercato possono determinare oscillazioni dei prezzi tali da far variare anche repentinamente il "Presunto Introito minimo/Esborso massimo in caso di smobilizzo": non vi è, quindi, alcuna certezza che i valori indicati siano rimasti invariati alla data in cui il rendiconto perviene al Cliente.

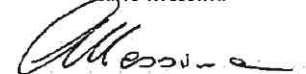
Qualora il campo "Presunto Introito minimo/Esborso massimo in caso di smobilizzo" riporti l'informazione Non Disponibile (ND), tale valore sarà fornito al Cliente tempestivamente su sua richiesta.

**Al fine di verificare la perdurante efficacia delle finalità per le quali erano stati originariamente stipulati i Contratti in essere, Vi invitiamo a comunicarci prontamente qualsiasi eventuale variazione intervenuta nella posizione debitoria/creditoria o esposizione sulle commodity sottostante a tali Contratti.**

Il Suo abituale referente è a disposizione per ogni ulteriore chiarimento.

Torino, 02 gennaio 2019

IL CONSIGLIERE DELEGATO E CEO  
Carlo Messina



## Report del valore di mercato delle operazioni di swap - Mark to Market (mtm) (\*)

Gli Importi sono da intendersi in Euro

Totale Differenziali passati

(1.005.792,36)

Mark to Market

(3.499.768,59)

### Descrizione dell'operazione

#### Note

(\*) Valore teorico di metà mercato del derivato calcolato alle condizioni di mercato della data di riferimento. Nella lettura del Mtm si dovrà inoltre considerare che il suo valore :

- varia di continuo in funzione della variazione dei tassi di interesse e della volatilità se nella struttura sono presenti opzioni;
- non riflette necessariamente le differenze esistenti tra lettera e denaro, trattandosi in genere di una media di mercato;
- si riferisce ad un preciso momento temporale;

- non costituisce proposta di conclusione di contratto, né termini negoziali secondo cui la Banca concluderebbe una operazione;

- non rappresenta il valore da corrispondere in relazione ad un'ipotesi di chiusura anticipata delle operazioni

(\*\*) I differenziali forniti sono stimati sulla base della curva dei tassi a termine (Forward) rilevata alla data del mtm (pubblicamente disponibile tra i dati diffusi da primari information providers : Reuters, Bloomberg. Tali valori, estrapolati dalla curva dei tassi rilevata nel giorno sopraindicato, potrebbero pertanto variare in base a successivi movimenti nell'andamento dei mercati e modificare conseguentemente - in un senso o nell'altro - i differenziali effettivamente scambiati alle scadenze contrattualmente previste.

Non rappresentano quindi per nessun motivo previsioni da parte del nostro Istituto, che li fornisce solo a titolo informativo.

Per quanto concerne i differenziali passati si fa presente che tali dati vengono qui forniti a titolo indicativo e non sostituiscono i dati ufficiali per i quali il cliente ha ricevuto regolari comunicazioni contabili.

# INTESA



# SANPAOLO

## Report del valore di mercato delle operazioni di swap - Mark to Market (mtm) (\*)

Gli importi sono da intendersi in Euro

### AMMINISTRAZIONE PROVINCIALE DI IMPERIA (13078991)

Data negoziazione	Data Scadenza			
Data Riferimento MTM	ns Reference		13078991	
Nominale Iniziale	Euribor 6 mesi fissato + eventuale Spread in liquidazione per valuta al	8.727.390,00	28-giu-19	-0,237%
Nominale Attuale		4.939.020,00	28-giu-19	-0,037%
	Differenziali in pagamento per valuta al	6.685.860,18	28-giu-19	(117.798,09)
Totale differenziali dalla data di negoziazione al	Stima Forward Euribor 6 mesi + eventuale Spread in liquidazione per valuta al	91.940,82	31-dic-19	-0,222%
		99.581,27	31-dic-19	-0,022%
	Stima differenziali in pagamento per valuta al	113.901,08	31-dic-19	(125.762,21)
		121.957,53		
		43.167,15		
		(30.445,92)		
		(45.189,03)		
		(47.383,18)		
		(40.184,62)		
		(22.812,54)		
		(32.808,07)		
		(62.612,14)		
		(80.995,24)		
		(86.301,94)		
		(82.124,92)		
		(87.977,97)		
		(91.887,07)		
		(99.039,97)		
		(101.337,85)		
		(107.584,18)		
		(110.465,52)		
		(112.889,97)		
		(115.319,82)		
		(118.980,25)		