

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

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.

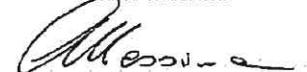
Qualora il campo "Presunto Introito minimo/Esborso massimo in caso di smobilizzo" riporti l'informazione Non Disponibile (ND), tale valore sarà fornito al Cliente tempestivamente su sua richiesta.

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.

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)
	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)	