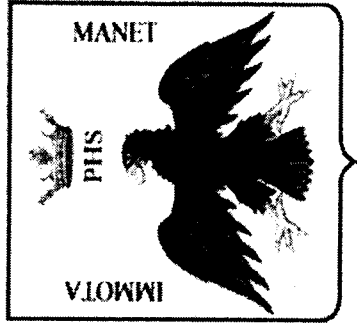


ALLEGATO W



ALLEGATO ALLA DELIBERA

C.C. N. 45..... DEL 29/6/19
MUNICIPALITÀ

IL PRESIDENTE

COMUNE DELL'AQUILA

DIPARTIMENTO SERVIZI AL CITTADINO

SETTORE BILANCIO E RAZIONALIZZAZIONE

SERVIZIO BILANCIO E RAZIONALIZZAZIONE DELLA SPESA

BILANCIO DI PREVISIONE 2019/2021

NOTA INFORMATIVA STRUMENTI DERIVATI

Città dell'Aquila

Prot n° 0044582 del 26/04/2019

ENTRATA



ID: OAA3038CZLZ

6174/LO/TIME/10/VE013

0009
P27903NE45A001DNDP DL 8701
21130754 01F417500077
D00P0105 5 2

66084

COMUNE DELL'AQUILA
PIAZZA DEL PALAZZO 1
67100 L AQUILA AQ

MILANO , 02.04.2019

Oggetto: Comunicazione mensile del valore di mercato delle Vostre operazioni in strumenti finanziari derivati OTC su tassi di interesse, tassi di cambio, merci e relativi indici in essere alla data del 31/03/2019.

Gentile Cliente ,

con la presente siamo a comunicarLe, a scopo informativo, il valore di mercato (Mark To Market – "MTM") delle operazioni in strumenti finanziari derivati OTC su tassi di interesse, tassi di cambio, merci e relativi indici (riportate nell'Allegato 1) che Lei ha in essere con la nostra Banca alla data del 31/03/2019 (*Data di Valutazione*).

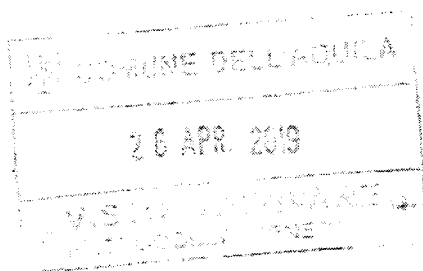
Cordiali saluti .

Andrea Casini

Remo Taricani

Co-CEO Commercial Banking Italy

UniCredit S.p.A.



Allegato 1

Operazioni in essere alla data del 31/03/2019

Controparte 1: Unicredit S.p.A.
 Controparte 2: COMUNE DELL'AQUILA
 Data di calcolo del MTM: 29/03/2019

Numero di riferimento operazione	Nozionale/quantità di riferimento - Divisa della operazione	Secondo nozionale/quantità di riferimento - Seconda Divisa (se applicabile)	Contratto	Data operazione	Data iniziale - Data Scadenza	Importo MTM - Divisa MTM	Cliente Buy/Sell
9162664	12.444.656,07 EUR	0,00	BASIC INTEREST-RATE SWAP	12/06/2001	30/06/2001 - 31/12/2025	2.379.794,06 EUR	

Operazioni estinte nel corso del mese

Numero di riferimento operazione	Nozionale/quantità di riferimento - Divisa della operazione	Secondo nozionale/quantità di riferimento - Seconda Divisa (se applicabile)	Contratto	Data operazione	Data iniziale - Data Estinzione	Importo MTM - Divisa MTM	Cliente Buy/Sell

NOTA INFORMATIVA STRUMENTI DERIVATI

ALLEGATO AL BILANCIO PER 2019/2021

Nota informativa ai sensi del comma 8, articolo 62 della Legge 133/2008, nel testo novellato dalla Legge 203/2008 (finanziaria 2009).

Analisi dell'operazione realizzata in strumenti derivati.

CONTRATTO DERIVATO DI DURATION SWAP.

Caratteristiche del contratto:

- Controparte: CREDITO ITALIANO SPA
- Nozionale Comune: ITL 11.617.620,000 pari ad Euro 6.000.000,00
- Nozionale Banca: ITL 24.096.212,276 pari ad Euro 12.444.650,00
- Data stipula contratto Swap: 12/06/2001
- Decorrenza: 30/06/2001
- Scadenza finale cliente: 31/12/2025
- Scadenza finale Banca: 31/12/2016

Trattasi di contratto di Interest Rate Swap che prevede lo scambio di flussi di cassa predeterminati all'atto della conclusione dell'operazione (tassi fissi) che fa sì che l'operazione risulti poco sensibile alle variazioni dei tassi di mercato:

- Tasso Comune: 5,65%
- Tasso Banca: 6,50%
- Up-front: ITL 1.900.000,000 pari ad Euro 981.268,10
- Scadenze periodiche semestrali
- Mark to market al 31.03.2019 = -2.379.794,09

DIFFERENZIALI IN SCADENZA PER IL TRIENNIO 2019-2021

30/06/2019	169.500,00
31/12/2019	169.500,00
	339.000,00

30/06/2020	169.500,00
31/12/2020	169.500,00
	339.000,00

30/06/2021	169.500,00
31/12/2021	169.500,00
	339.000,00