

Finanza

Pricing DERIVATI OTC -dicembre 2017

STRUMENTI DERIVATI SU TASSI						
MERCATO PRIMARIO	MARK UP (MARGINE COMMERCIALE)		MINIMI MARK-UP (MARGINE COMMERCIALE)		COSTI DI COPERTURA	SPESE FISSE
	fino a 5 anni (*)	oltre 5 anni (*)	nozionale riferimento			
IRS Plain Vanilla	max 0,30%	max 0,40%	euro 2.500 euro 5.000 euro 7.500 euro 10.000	per nozionali fino a eur 500.000 per nozionali da eur 500.001 fino a eur 1.500.000 per nozionali da eur 1.500.001 fino a eur 5.000.000 per nozionali oltre eur 5.000.000	max 2,00% del nozionale	euro 50
IRS Strutturati / FRA	max 0,40%	max 0,50%				
OPZIONI Plain Vanilla premio immediato	max 0,30%					
OPZIONI Strutturate premio immediato	max 0,40%					
OPZIONI Plain Vanilla premio dilazionato	max 0,30%	max 0,40%				
OPZIONI Strutturate premio dilazionato	max 0,40%	max 0,50%				
MERCATO SECONDARIO (Rinegoiazione / estinzione anticipata)						
IRS Plain Vanilla e Strutturati / FRA	max 1,00% del nozionale		euro 500	L'ammontare del mark-up in fase di estinzione non potrà comunque superare l'ammontare del mark-up in sede di stipula	max 2% del nozionale	
OPZIONI						
STRUMENTI DERIVATI SU CAMBI						
MERCATO PRIMARIO	MARK UP (MARGINE COMMERCIALE)		MINIMI MARK-UP (MARGINE COMM. LE)		COSTI DI COPERTURA	SPESE FISSE
			nozionale riferimento			
OPZIONI Plain Vanilla	max 1,00% del controvalore in euro del nozionale (quello maggiore in caso di struttura con leva)		euro 1.000		max 2,00% del controvalore in euro del nozionale (quello maggiore in caso di struttura con leva)	euro 50
OPZIONI Strutturate						
FLEXIBLE FORWARD (**)						
MERCATO SECONDARIO (Rinegoiazione / estinzione anticipata)						
OPZIONI	max 1,00% del controvalore in euro del nozionale (quello maggiore in caso di struttura con leva)		euro 500	L'ammontare del mark-up in fase di estinzione non potrà comunque superare l'ammontare del mark-up in sede di stipula	max 2,00% del controvalore in euro del nozionale (quello maggiore in caso di struttura con leva)	

(*) %annua calcolata sul nozionale per tutti gli anni di durata

(**) di prossima introduzione