

PARTE II

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI

GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS

NOTE METODOLOGICHE

Gli indici e i dati della Parte II si riferiscono ai titoli di Stato e alle obbligazioni quotati nella Borsa italiana. Per alcune tabelle gli importi prima espressi in lire sono stati convertiti in euro al tasso di cambio di 1.936,27 lire.

Tabella I

Riporta i dati sulle emissioni e i rimborsi di BOT (Buoni Ordinari del Tesoro) assegnati mediante asta. I rendimenti annui sono calcolati in base ai rendimenti all'emissione ponderati per il rapporto tra il rispettivo importo aggiudicato e il totale delle emissioni nel periodo.

Tabelle II, III e IV

Riportano dati sulle emissioni e i rimborsi di BTP (Buoni del Tesoro Poliennali) e certificati di credito emessi dal Tesoro (CCT, CTZ), limitatamente ai titoli ammessi di diritto alla quotazione in Borsa. Gli importi, relativi al mese di effettuazione dell'asta, sono indicati al valore nominale. I prezzi di aggiudicazione si riferiscono alla prima tranche.

Tabelle V e VI

La Tabella V riporta dati relativi alle obbligazioni e ai titoli di Stato quotati che, alla data del 30 giugno 2016, erano in circolazione per un importo non inferiore a 3,9 milioni di euro e che, nei dodici mesi precedenti tale data, sono risultati scambiati per un controvalore – al valore nominale – non inferiore a 0,5 milioni di euro. L'interesse periodico è riferito all'anno, con l'eccezione dei titoli con cedole indicizzate semestrali o trimestrali, per i quali viene indicata la cedola in vigore al 30 giugno 2016. Il prezzo di emissione (prezzo di aggiudicazione della prima tranche per i BTP ed i CCT) viene indicato, di norma, per i soli titoli offerti al pubblico. Eventuali differenze tra l'importo nominale emesso e l'importo in circolazione al 30 giugno 2016 sono imputabili a rimborsi o riacquisti da parte dell'emittente.

Le modalità di indicizzazione degli interessi e del capitale dei titoli compresi nella Tabella V sono riportate nella Tabella VI.

Tabella VII

Nella tabella sono inclusi titoli della Tabella V che soddisfano i seguenti requisiti: denominazione in euro o in lire, quotazione in Borsa antecedente il 2 gennaio 2015, controvalore scambiato nell'anno 2015 non inferiore a 2,6 milioni di euro, vita media residua non inferiore ai 12 mesi. La vita media residua è pari alla media ponderata delle vite residue delle singole rate di rimborso del capitale; i pesi sono costituiti dai rapporti tra le singole rate di rimborso e l'ammontare complessivo ancora da rimborsare. Il rendimento medio annuo realizzato è riferito all'ipotesi che l'obbligazionista, alle date indicate come basi, abbia investito un euro nel titolo obbligazionario, reimpiegando successivamente, nello stesso titolo e al prezzo "ex", tutti i proventi lordi pagati dal titolo. Per proventi lordi si sono intesi tutti i flussi monetari per interessi, premi e capitale, al lordo del prelievo fiscale. Le quantità aggiuntive del titolo, ottenute con il reinvestimento dei proventi lordi, sono state sommate al portafoglio dell'obbligazionista e il possesso complessivo è stato valutato al corso "tel quel" dell'ultimo giorno operativo del mese di giugno 2016. Il rendimento annuo realizzato è stato calcolato in base alla relazione ad interesse composto tra il valore del portafoglio finale e l'investimento iniziale. Il rendimento annuo immediato lordo è stato calcolato come rapporto tra la cedola lorda in vigore al 30 giugno 2016 e il corso secco del titolo alla medesima data. Il rendimento effettivo è stato ottenuto calcolando il saggio che uguaglia il valore attuale di tutte le prestazioni future per capitale, interessi, premi e sovrapprezzi al valore di mercato del prestito, pari al corso secco maggiorato dei dietimi di interesse. Il rendimento effettivo dei titoli indicizzati nella cedola o nel valore di rimborso è stato calcolato utilizzando, per le cedole e le maggiorazioni al rimborso non

ancora determinate al 30 giugno 2016, i valori più recenti, noti a tale data, dei parametri di indicizzazione di ciascun prestito. Il rendimento effettivo non è calcolato per quei prestiti il cui piano di ammortamento presenti elementi di incertezza quali: a) maggiorazioni sul rimborso del capitale a scadenza indicizzate a livelli di indici, quote di fondi e altri parametri non determinabili oggettivamente alla data di calcolo del rendimento a scadenza; b) opzioni esercitabili a discrezione dell'emittente per rimborsare anticipatamente i prestiti o modificarne le caratteristiche; c) parametri di indicizzazione delle cedole destinati a divenire effettivi in tempi distanti da quelli di calcolo del rendimento a scadenza. Per le obbligazioni convertibili è stato calcolato il premio (indicato con segno positivo) o lo sconto (indicato con segno negativo) di conversione. Il premio o lo sconto sono stati calcolati come differenza tra il valore di mercato delle obbligazioni e il valore di mercato delle azioni di compendio, in percentuale di quest'ultimo valore e nell'ipotesi di conversione alla data di riferimento, indipendentemente dal periodo contrattualmente previsto.

Tabella VIII

Riporta il controvalore nominale delle obbligazioni quotate nell'ultimo giorno operativo degli anni dal 2006 al 2015, in circolazione alle stesse date per un importo non inferiore a 3,9 milioni di euro. Sono escluse le obbligazioni in valuta estera e le obbligazioni convertibili. Sono incluse le rate capitali estratte con rimborso all'1 gennaio dell'anno successivo.

Tabella IX

Riporta il rendimento effettivo lordo medio mensile di un gruppo di titoli di Stato e obbligazioni, a tasso fisso e indicizzati, scelti tra i più trattati in Borsa nel periodo tra l'ottobre 1986 e il giugno 2016. Per una descrizione dettagliata della metodologia di calcolo ed ulteriori dettagli si rimanda alle apposite brochure, disponibili su richiesta.

Tabella X

La tabella riporta, per il periodo compreso tra il gennaio 2006 e il giugno 2016, un raffronto tra:

- il tasso mensile tendenziale di inflazione (misurato dalla variazione percentuale dei prezzi al consumo per le famiglie di operai e impiegati rispetto allo stesso mese dell'anno precedente);
- il rendimento annuo all'emissione dei Buoni Ordinari del Tesoro a 12 mesi, dato dalla media dei rendimenti delle aste tenute nel mese;
- il tasso d'interesse MFI - Monetary Financial Institutions (pubblicato dalla Banca Centrale Europea) corrisposto dalle imprese finanziarie dell'area euro alle famiglie e alle imprese non finanziarie sui depositi a termine in essere, con scadenza superiore ai 2 anni.

Si sono adoperati i seguenti segni convenzionali:

- dato nullo o non rilevabile
- * dato inferiore all'unità di rilevazione
- # titolo di prima emissione

NOTES

All the information given in Part II refers to Government securities and bonds listed on the Italian stock exchange. Some of the tables give figure in Euros, which have been translated at the fixed exchange rate of Lit. 1,936.27 to the Euro.

Table I

This provides data on the issue and redemption of BOTs allotted by auction. Average annual yield has been computed by weighting yield on issue by the amount allotted.

Tables II, III and IV

These tables provide data on the issue and redemption of those BTPs (Treasury Bills with maturities of over 12 months), BTPis (BTPs indexed to inflation) and CCTs (Treasury Credit Certificates) which are automatically eligible for listing. Amounts are stated at par. Data in italics to the right of the issue date denote fixed-interest, convertible certificates (half zero coupon and half floating-rate bonds), Ecu-denominated securities, Treasury Credit Certificates "con opzione" (retractable/extendible bonds) and zero coupon bonds. The price given is the allotment price for the first tranche.

Tables V and VI

Table V provides information on all listed bonds and Government securities in issue as at 30th June 2016 in amounts of not less than 3.9 million Euros for which trading volume on Italian stock exchanges in the twelve months then ended was not less than 0.5 million euros nominal value. Interest for the period refers to the year, except for index-linked securities carrying quarterly on half-yearly coupons. The rate given on these is that on the coupon maturing on 30th June 2016. Issue prices (or first tranche allotment prices for BTPs and CCTs) are generally given for bonds offered to the public. Table VI gives the methods used for index-linking principal and interest on the bonds listed in Table V.

Table VII

Table VII includes bonds in Table V which are denominated in euro or lire, were admitted to the official list prior to 2nd January 2015, had a trading volume in 2015 of not less than 2.6 million euros and had an average residual maturity of at least 12 months. The annualized gross holding period return has been based on the assumption that the bondholder invested one euro in the bonds concerned on the base date and reinvested all gross proceeds from the bonds back into the same bonds at the price quoted on the first "ex-div" date. Such proceeds are defined as the entire income stream in interest, premiums and principal, gross of withholding tax. The additional bonds acquired by reinvesting proceeds are added to the holding, and the total holding is then priced at quotation plus accrued interest on 30th June 2016. The annualized holding period return has been extrapolated from the compound interest relationship between the final value of the holding and the initial investment. The interest yield has been computed as the ratio between the gross interest coupon outstanding at 30th June 2016 and the price of the bond at that date less accrued interest. Redemption yield on each issue is computed as the internal rate of return which makes the present value of the future gross income stream in the form of principal, interest, bonuses and premiums equal to the market price of the issue on the date of purchase plus accrued interest. In the case of issues with index-linked interest or redemption value as yet undetermined, redemption yield has been calculated on the basis of the most recent reference indices known at 30th June 2016. Effective yield has not been calculated for issues where the redemption programme presents elements of uncertainty, such as: a) premiums over redemption of principal at maturity linked to indexes, fund units and other units of measurement not objectively determinable as at the date of calculating yield at maturity; b) options which may be exercised at the issuer's discretion in order to redeem the issues early or amend their features; c) criteria for index-linking coupons due to take effect at times which are

distant from those for calculating yield at maturity. Premiums (+ sign), and discounts (– sign), on the conversion of convertible bonds have also been computed. Premiums and discounts have been computed as the difference between the market value of the bonds and the market value of the underlying shares as a percentage of such value on the assumption that the bonds were converted on the reference date, irrespective of the bond indenture. Account has been taken of any expense arising on conversion including any forced waiver of interest accrued up to the conversion date.

Table VIII

This table gives the amounts of listed bonds in issue at the dates given selected on the same principles as those set out for Table V. It does not include bonds denominated in currencies other than the euro or the lira, and convertible bonds. It includes principal amounts drawn by lot redeemable on 1st January of the following year.

Table IX

Table IX gives the gross monthly average redemption yields of Italian Government securities and bonds selected on the basis of high trading volume (at par) on Italian stock exchange during the period from October 1986 to June 2016. A description of the methods of selection and calculation and further details can be found in two booklets ("Average redemption yield on selected Italian Government securities and bonds" and "Rendimento effettivo medio di un gruppo di titoli di Stato e obbligazioni - Riepilogo"), which are available on request.

Table X

Table X shows:

- the monthly inflation rate in Italy based on year-on-year percentage changes in the retail price index used to calculate sliding scale wage increments;
- the annual yield on 12-month BOTs based on issue price (the yield given is the average between the mid-month and end-month auction);
- the MFI – Monetary Financial Institutions – interest rate published by the European Central Bank paid by Eurozone financial institutions to households and non-financial institutions on outstanding term deposits, with maturities in excess of two years.

The table covers the period between 1st January 2006 and 30th June 2016.

The following conventional symbols are used in the tables:

- no applicable or no available figure
- * less than unit employed
- # first issue

BUONI ORDINARI DEL TESORO EMESSI E
ORDINARY TREASURY BILLS ISSUED AND

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

(milioni di euro)

	Importo offerto	Importo aggiudicato (a)	Importo non aggiudicato	Importo rimborsato (b)	(a) - (b)	Rendimento annuo lordo	Rendimento annuo netto
B.O.T a 3 mesi							
2006							
1° semestre	17.500	17.500	—	10.500	7.000	2,65	—
2° semestre	2.500	2.500	—	10.500	- 8.000	3,42	—
	20.000	20.000	—	21.000	- 1.000	2,75	—
2007							
1° semestre	18.000	18.000	—	11.500	6.500	3,86	—
2° semestre	12.000	12.000	—	15.000	- 3.000	3,94	—
	30.000	30.000	—	26.500	3.500	3,94	—
2008							
1° semestre	11.000	11.000	—	9.500	1.500	4,06	—
2° semestre	28.000	28.000	—	18.000	10.000	3,30	—
	39.000	39.000	—	27.500	11.500	3,51	—
2009							
1° semestre	34.450	34.450	—	32.000	2.450	1,19	—
2° semestre	8.500	8.500	—	28.450	- 19.950	0,44	—
	42.950	42.950	—	60.450	- 17.500	1,04	—
2010							
1° semestre	10.000	10.000	—	3.500	6.500	0,52	—
2° semestre	3.500	3.500	—	10.000	- 6.500	0,68	—
	13.500	13.500	—	13.500	—	0,56	—
2011							
1° semestre	3.500	3.500	—	3.500	—	1,03	—
2° semestre	4.000	4.000	—	4.000	—	1,91	—
	7.500	7.500	—	7.500	—	1,50	—
2012							
1° semestre	9.500	9.500	—	3.500	6.000	0,85	—
2° semestre	6.000	6.000	—	9.000	- 3.000	0,73	—
	15.500	15.500	—	12.500	3.000	0,80	—
2013							
1° semestre	3.000	3.000	—	3.000	—	0,24	—
2° semestre	—	—	—	3.000	- 3.000	—	—
	3.000	3.000	—	6.000	- 3.000	0,24	—
2014							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	—	—	—	—	—	—	—
	—	—	—	—	—	—	—
2015							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	—	—	—	—	—	—	—
	—	—	—	—	—	—	—
2016							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—

	Importo offerto	Importo aggiudicato (a)	Importo non aggiudicato	Importo rimborsato (b)	(a) - (b)	Rendimento annuo lordo	Rendimento annuo netto
B.O.T a 6 mesi							
2006							
1° semestre	53.803	53.803	—	51.806	1.997	2,85	—
2° semestre	53.280	53.280	—	53.803	- 523	3,46	—
	107.083	107.083	—	105.609	1.474	3,15	—
2007							
1° semestre	53.750	53.750	—	53.280	470	3,99	—
2° semestre	55.302	55.302	—	53.750	1.552	4,06	—
	109.052	109.052	—	107.030	2.022	4,03	—
2008							
1° semestre	57.795	57.795	—	55.302	2.493	4,11	—
2° semestre	62.646	62.646	—	57.795	4.851	3,37	—
	120.441	120.441	—	113.097	7.344	3,73	—
2009							
1° semestre	43.000	43.000	—	62.646	- 19.646	1,14	—
2° semestre	62.547	51.808	10.739	43.000	8.808	0,60	—
	105.547	94.808	10.739	105.646	- 10.837	0,82	—
2010							
1° semestre	57.088	57.088	—	61.798	- 4.710	0,81	—
2° semestre	55.290	55.290	—	57.088	- 1.798	1,23	—
	112.378	112.378	—	118.886	- 6.508	1,02	—
2011							
1° semestre	51.925	51.925	—	55.290	- 3.365	1,57	—
2° semestre	52.928	52.928	—	51.925	1.003	3,48	—
	104.853	104.853	—	107.215	- 2.362	2,53	—
2012							
1° semestre	53.716	53.176	—	52.928	788	1,88	—
2° semestre	54.382	57.007	- 2.625	53.716	3.291	1,46	—
	108.098	110.723	- 2.625	106.644	4.079	1,67	—
2013							
1° semestre	56.861	56.861	—	57.007	- 146	0,82	—
2° semestre	51.845	51.994	- 149	56.861	- 4.867	0,75	—
	108.706	108.855	- 149	113.868	- 5.013	0,79	—
2014							
1° semestre	49.500	48.111	1.388	51.994	- 3.883	0,49	—
2° semestre	44.350	42.723	1.626	48.111	5.388	0,26	—
	93.850	90.834	3.014	100.105	- 9.271	0,38	—
2015							
1° semestre	42.644	41.356	1.288	42.723	- 1.367	0,06	—
2° semestre	33.550	31.750	1.800	41.356	- 9.606	0,03	—
	76.194	73.106	3.088	84.079	- 10.973	0,05	—
2016							
1° semestre	40.425	38.981	1.443	31.750	7.231	0,12	—

BUONI ORDINARI DEL TESORO EMESSI E
ORDINARY TREASURY BILLS ISSUED AND

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

(milioni di euro)

	Importo offerto	Importo aggiudicato (a)	Importo non aggiudicato	Importo rimborsato (b)	(a) - (b)	Rendimento annuo lordo	Rendimento annuo netto
B.O.T a 12 mesi							
2006							
1° semestre	45.000	45.000	—	41.000	4.000	2,97	—
2° semestre	34.000	34.000	—	33.500	500	3,58	—
	79.000	79.000	—	74.500	4.500	3,23	—
2007							
1° semestre	44.000	44.000	—	42.500	1.500	4,04	—
2° semestre	37.000	37.000	—	38.500	- 1.500	4,12	—
	81.000	81.000	—	81.000	—	4,08	—
2008							
1° semestre	45.500	45.156	343	42.000	3.156	3,90	—
2° semestre	37.500	37.500	—	38.000	- 500	3,58	—
	83.000	82.656	343	80.000	2.656	3,76	—
2009							
1° semestre	50.650	50.650	—	41.656	8.993	1,37	—
2° semestre	34.712	41.147	- 6.435	41.000	147	0,87	—
	85.362	91.797	- 6.435	82.656	9.140	1,17	—
2010							
1° semestre	44.247	44.247	—	47.150	- 2.903	1,05	—
2° semestre	39.711	39.711	—	34.712	4.999	1,53	—
	83.958	83.958	—	81.862	2.096	1,28	—
2011							
1° semestre	44.940	44.940	—	44.247	693	2,04	—
2° semestre	43.725	43.725	—	39.711	4.013	4,33	—
	88.665	88.665	—	83.958	4.706	3,17	—
2012							
1° semestre	49.612	49.612	—	44.940	4.672	2,56	—
2° semestre	50.373	50.373	—	43.725	6.648	2,04	—
	99.985	99.985	—	88.665	11.320	2,30	—
2013							
1° semestre	50.059	50.059	—	49.612	447	0,97	—
2° semestre	47.825	47.825	—	50.373	- 2.548	1,01	—
	97.884	97.884	—	99.985	- 2.101	0,99	—
2014							
1° semestre	46.671	46.671	—	50.059	- 3.388	0,63	—
2° semestre	44.625	43.801	823	47.825	- 4.024	0,32	—
	91.296	90.472	823	97.884	- 7.412	0,48	—
2015							
1° semestre	45.091	43.406	1.685	46.671	- 3.265	0,11	—
2° semestre	41.600	39.767	1.832	43.801	- 4.034	0,03	—
	86.691	83.173	3.517	90.472	- 7.299	0,07	—
2016							
1° semestre	41.850	39.175	2.675	43.406	- 4.231	0,09	—

	Importo offerto	Importo aggiudicato (a)	Importo non aggiudicato	Importo rimborsato (b)	(a) - (b)	Rendimento annuo lordo	Rendimento annuo netto
B.O.T flessibili							
2006							
1° semestre	4.500	4.500	—	2.000	2.500	2,79	—
2° semestre	—	—	—	2.500	- 2.500	—	—
	4.500	4.500	—	4.500	—	2,79	—
2007							
1° semestre	4.500	4.500	—	2.500	2.000	3,95	—
2° semestre	5.000	5.000	—	7.000	- 2.000	4,08	—
	9.500	9.500	—	9.500	—	4,02	—
2008							
1° semestre	21.500	21.500	—	5.500	16.000	4,15	—
2° semestre	6.000	6.000	—	22.000	- 16.000	4,35	—
	27.500	27.500	—	27.500	—	4,19	—
2009							
1° semestre	9.500	9.500	—	2.500	7.000	1,24	—
2° semestre	—	—	—	7.000	- 7.000	—	—
	9.500	9.500	—	9.500	—	1,24	—
2010							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2011							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	2.500	2.500	—	2.500	—	1,74	—
	2.500	2.500	—	2.500	—	1,74	—
2012							
1° semestre	13.500	13.500	—	7.000	6.500	1,65	—
2° semestre	—	—	—	6.500	- 6.500	—	—
	13.500	13.500	—	13.500	—	1,65	—
2013							
1° semestre	3.000	3.000	—	—	3.000	0,39	—
2° semestre	5.500	5.500	—	8.500	- 3.000	0,55	—
	8.500	8.500	—	8.500	—	0,49	—
2014							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2015							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2016							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—

BUONI ORDINARI DEL TESORO EMESSI E RIMBORSATI
ORDINARY TREASURY BILLS ISSUED AND REDEEMED

DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016 - RIEPILOGO
BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016 - OVERALL TOTAL

(milioni di euro)

	Importo offerto	Importo aggiudicato (a)	Importo non aggiudicato	Importo rimborsato (b)	(a) - (b)	Composizione percentuale degli importi aggiudicati			Altre scadenze
						3 mesi	6 mesi	12 mesi	
Totale									
2006									
1° semestre	120.803	120.803	—	105.306	15.497	14,49	44,54	37,25	3,73
2° semestre	89.780	89.780	—	100.303	- 10.523	2,78	59,35	37,87	—
	210.583	210.583	—	205.609	4.974				
2007									
1° semestre	120.250	120.250	—	109.780	10.470	14,97	44,70	36,59	3,74
2° semestre	109.302	109.302	—	114.250	- 4.948	10,98	50,60	33,85	4,57
	229.552	229.552	—	224.030	5.522				
2008									
1° semestre	135.795	135.451	343	112.302	23.149	8,12	42,67	33,34	15,87
2° semestre	134.146	134.146	—	135.795	- 1.649	20,87	46,70	27,95	4,47
	269.941	269.597	343	248.097	21.500				
2009									
1° semestre	137.600	137.600	—	138.802	- 1.203	25,04	31,25	36,81	6,90
2° semestre	105.759	101.455	4.304	119.450	- 17.995	8,38	51,07	40,56	—
	243.359	239.055	4.304	258.252	- 19.198				
2010									
1° semestre	111.335	111.335	—	112.448	- 1.113	8,98	51,28	39,74	—
2° semestre	98.501	98.501	—	101.800	- 3.299	3,55	56,13	40,32	—
	209.836	209.836	—	214.248	- 4.412				
2011									
1° semestre	100.365	100.365	—	103.037	- 2.672	3,49	51,74	44,78	—
2° semestre	103.153	103.153	—	98.136	5.016	3,88	51,31	42,39	2,42
	203.518	203.518	—	201.173	2.344				
2012									
1° semestre	126.328	126.328	—	108.368	17.960	7,52	42,52	39,27	10,69
2° semestre	110.755	113.380	- 2.625	112.941	439	5,29	50,28	44,43	—
	237.083	239.708	- 2.625	221.309	18.399				
2013									
1° semestre	112.920	112.920	—	109.619	3.301	2,66	50,36	44,33	2,66
2° semestre	105.170	105.319	- 149	118.734	- 13.415	—	49,37	45,41	5,22
	218.090	218.239	- 149	228.353	- 10.114	—	—	—	—

	Importo offerto	Importo aggiudicato (a)	Importo non aggiudicato	Importo rimborsato (b)	(a) - (b)	Composizione percentuale degli importi aggiudicati			Altre scadenze
						3 mesi	6 mesi	12 mesi	
2014									
1° semestre	96.171	94.782	1.388	102.053	- 7.271	—	50,76	49,24	—
2° semestre	88.975	86.524	2.449	95.936	- 9.412	—	49,38	50,62	—
	185.146	181.306	3.837	197.989	- 16.683	—	—	—	—
2015									
1° semestre	87.735	84.762	2.973	89.394	- 4.632	—	48,79	51,21	—
2° semestre	75.150	71.517	3.632	85.157	- 13.640	—	44,40	55,60	—
	162.885	156.279	6.605	174.551	- 18.272	—	—	—	—
2016									
1° semestre	82.275	78.156	4.118	75.156	3.000	—	49,88	50,12	—

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
2006								
Gennaio.....	387292	15-VI-2010	100,57	1,375	2.750	19.580	—	19.580
	393465	1-II-2037	101,29	2,000	2.500			
	6) 400967 #	1-VIII-2021	98,26	1,875	5.000			
	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	776			
	380599	15-IX-2010	99,90	0,475	1.500			
	384453	1-VIII-2015	101,79	1,875	2.750			
	400812 #	1-II-2009	99,82	1,500	4.304			
Febbraio.....	387292	15-VI-2010	100,57	1,375	2.500	12.500	22.090	-9.590
	393465	1-II-2037	101,29	2,000	2.000			
	400812	1-II-2009	99,82	1,500	3.000			
	401958 #	1-VIII-2016	100,36	1,875	5.000			
Marzo.....	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	2.200	13.950	11.926	2.024
	402629 #	15-III-2011	100,06	1,750	5.000			
	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	750			
	400812	1-II-2009	99,82	1,500	3.000			
	401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	3.000			
Aprile.....	2) 317194	1-III-2007	100,10	2,250	-312	14.207	632	13.575
	3) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	1.154			
	4) 380485	1-II-2008	100,45	1,375	-320			
	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	2.000			
	402629	15-III-2011	100,06	1,750	3.500			
	380599	15-IX-2010	99,90	0,475	1.503			
	400812	1-II-2009	99,82	1,500	3.300			
	401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	2.750			
	Maggio.....	393465	1-II-2037	101,29	2,000			
402629		15-III-2011	100,06	1,750	3.000			
374554		15-IX-2035	99,68	1,175	550			
400812		1-II-2009	99,82	1,500	3.000			
401958		1-VIII-2016	100,36	1,875	2.500			
Giugno.....	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	2.000	15.372	—	15.372
	402629	15-III-2011	100,06	1,750	2.500			
	408521 #	15-IX-2017	99,52	1,050	4.000			
	401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	2.002			
	408524 #	15-VI-2009	100,13	1,875	4.870			

1) Collocato presso gli investitori da un consorzio di banche. - 2) Riacquistato con l'asta di concambio del 3-IV-2006 al prezzo di 101,242. - 3) Asta di concambio del 3-IV-2006. - 4) Riacquistato con l'asta di concambio del 3-IV-2006 al prezzo di 99,01.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Luglio.....	393465	1-II-2037	101,28	2,000	2.200	10.785	8.424	2.360
	402629	15-III-2011	100,06	1,750	2.200			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.100			
	401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	2.750			
Agosto.....	408524	15-VI-2009	100,13	1,875	2.535	4.200	—	4.200
	401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	2.200			
	408524	15-VI-2009	100,13	1,875	2.000			
Settembre.....	411281 #	15-IX-2011	100,17	1,875	4.331	8.842	14.153	-5.311
	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	511			
	401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	2.000			
	408524	15-VI-2009	100,13	1,875	2.000			
Ottobre.....	411281	15-IX-2011	100,17	1,875	2.500	7.800	—	7.800
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.100			
	401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	2.200			
	408524	15-VI-2009	100,13	1,875	2.000			
Novembre.....	411281	15-IX-2011	100,17	1,875	2.000	3.415	8.490	-5.075
	1) 317194	1-III-2007	100,10	2,250	-502			
	2) 327101	15-X-2007	100,32	2,500	-282			
	3) 387770	15-VI-2008	100,95	1,250	-135			
	4) 400812	1-II-2009	99,82	1,500	-233			
Dicembre.....	5) 400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	1.415	6.208	6) 1.701	4.507
	408524	15-VI-2009	100,13	1,875	2.000			
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	4.208			
Totali.....						127.909	79.315	48.593
2007								
Gennaio.....	393465	1-II-2037	101,28	2,000	2.000	11.250	15.650	-4.400
	411281	15-IX-2011	100,17	1,875	2.500			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.250			
	408524	15-VI-2009	100,13	1,875	2.000			
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	3.500			
Febbraio.....	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	4.165	15.490	10.558	4.932
	411281	15-IX-2011	100,17	1,875	2.750			
	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	825			
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	2.750			
	419691 #	1-III-2010	100,38	2,000	5.000			

1) Riacquistato con l'asta di concambio del 30-XI-2006 al prezzo di 100,228. - 2) Riacquistato con l'asta di concambio del 30-XI-2006 al prezzo di 101,094. - 3) Riacquistato con l'asta di concambio del 30-XI-2006 al prezzo di 98,26. - 4) Riacquistato con l'asta di concambio del 30-XI-2006 al prezzo di 98,60. - 5) Asta di concambio del 30-XI-2006. - 6) Di cui Euro 1.701 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità.

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Marzo.....	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	2.500	15.311	16.799	-1.488
	411281	15-IX-2011	100,17	1,875	2.500			
	1) 122430	1-V-2008	98,70	2,500	-258			
	2) 327101	15-X-2007	100,32	2,500	-599			
	3) 367423	1-VI-2007	100,27	1,500	-375			
	4) 387770	15-VI-2008	100,95	1,250	-119			
	5) 402629	15-III-2011	100,06	1,750	1.561			
	421635 #	15-IX-2012	100,26	0,925	3.000			
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	2.750			
	419691	1-III-2010	100,38	2,000	3.000			
Aprile.....	393465	1-II-2037	101,28	2,000	2.500	14.050	—	14.050
	422062 #	15-IV-2012	99,40	2,000	4.000			
	421635	15-IX-2012	100,26	0,925	1.500			
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	3.300			
	419691	1-III-2010	100,38	2,000	2.750			
Maggio.....	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	2.500	12.600	—	12.600
	422062	15-IV-2012	99,40	2,000	3.000			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.600			
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	3.000			
	419691	1-III-2010	100,38	2,000	2.500			
Giugno.....	393465	1-II-2037	101,28	2,000	1.500	12.400	6) 15.409	-3.009
	422062	15-IV-2012	99,40	2,000	2.500			
	424351 #	15-IX-2023	99,09	1,300	4.000			
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	2.200			
	419691	1-III-2010	100,38	2,000	2.200			
Luglio.....	422062	15-IV-2012	99,40	2,000	2.750	10.230	8.427	1.803
	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	421			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	984			
	324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	2.000			
	425435 #	1-VIII-2010	100,30	2,250	4.075			
	Agosto.....	425435	1-VIII-2010	100,30	2,250			
427349 #		1-II-2018	99,98	2,250	4.000			
Settembre.....	7) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	1.493	11.561	—	11.561
	422062	15-IV-2012	99,40	2,000	2.500			
	421635	15-IX-2012	100,26	0,925	1.003			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	515			
	425435	1-VIII-2010	100,30	2,250	2.750			
	427349	1-II-2018	99,98	2,250	3.300			

1) Riacquistato al prezzo di 101,076 con l'asta di concambio del 23-III-2007. - 2) Riacquistato al prezzo di 100,575 con l'asta di concambio del 23-III-2007. - 3) Riacquistato al prezzo di 99,856 con l'asta di concambio del 23-III-2007. 4) Riacquistato al prezzo di 98,261 con l'asta di concambio del 23-III-2007. - 5) Asta di concambio del 23-III-2007. - 6) Di cui Euro 4.050 milioni in rimborsi a scadenza a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 7) Asta di concambio del 12-IX-2007.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Ottobre.....	428433 #	15-X-2012	99,85	2,125	4.000	15.031	14.838	193
	428696 #	1-VIII-2039	99,98	2,500	5.000			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.031			
	425435	1-VIII-2010	100,30	2,250	2.500			
	427349	1-II-2018	99,98	2,250	2.500			
Novembre.....	428433	15-X-2012	99,85	2,125	2.750	2.750	1) 16.675	13.925
Dicembre.....	425435	1-VIII-2010	100,30	2,250	2.750	6.050	2) 2.666	3.384
	427349	1-II-2018	99,98	2,250	3.300			
Totali.....						133.223	101.024	32.198
2008								
Gennaio.....	428433	15-X-2012	99,85	2,125	3.300	12.985	14.141	-1.156
	428696	1-VIII-2039	99,98	2,500	2.200			
	421635	15-IX-2012	100,26	0,925	1.435			
	425435	1-VIII-2010	100,30	2,250	3.300			
	427349	1-II-2018	99,98	2,250	2.750			
Febbraio.....	428433	15-X-2012	99,85	2,125	3.300	12.700	15.770	-3.070
	427349	1-II-2018	99,98	2,250	2.750			
	433252 #	1-II-2011	100,33	1,875	5.000			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.650			
Marzo.....	3) 122430	1-V-2008	98,70	2,500	-178	11.989	237	11.752
	4) 335798	1-II-2013	100,20	2,375	865			
	5) 387770	15-VI-2008	100,95	1,250	-59			
	428433	15-X-2012	99,85	2,125	3.149			
	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	550			
	421635	15-IX-2012	100,26	0,925	1.650			
Aprile.....	427349	1-II-2018	99,98	2,250	3.025	17.320	—	17.320
	433252	1-II-2011	100,33	1,875	2.750			
	6) 435684 #	1-VIII-2023	99,13	2,375	4.000			
	347233	1-VIII-2013	100,04	2,125	1.950			
	361838	1-VIII-2014	99,20	2,125	2.000			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	1.620			
	433252	1-II-2011	100,33	1,875	2.750			
	436104 #	1-VIII-2018	99,19	2,250	5.000			

1) Di cui Euro 1,933 miliardi riacquistati mediante asta in data 30-XI-2007. Riacquistato con l'asta di concambio del 1-XII-2008 al prezzo di 90,90. - 2) Di cui Euro 2.666 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. Asta di concambio del 1-XII-2008. - 3) Riacquistato al prezzo di 100,12 con l'asta di concambio del 7-III-2008. - 4) Asta di concambio del 7-III-2008. - 5) Riacquistato al prezzo di 99,61 con l'asta di concambio del 7-III-2008. - 6) Collocato presso gli investitori da un consorzio di banche al prezzo di 99,135.

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Maggio	1) 127336	1-V-2009	100,45	2,250	- 282	17.395	22.277	- 4.882
	2) 349325	1-II-2019	99,16	2,125	1.595			
	428696	1-VIII-2039	99,98	2,500	2.000			
	436555 #	15-IV-2013	100,00	2,125	4.000			
	3) 438054 #	15-IX-2019	99,78	1,175	4.000			
	433252	1-II-2011	100,33	1,875	2.500			
	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	3.300			
Giugno	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	2.043	11.968	17.486	- 5.518
	436555	15-IV-2013	100,00	2,125	2.500			
	421635	15-IX-2012	100,26	0,925	1.100			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	825			
	433252	1-II-2011	100,33	1,875	3.000			
	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	2.500			
	Luglio	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375			
436555		15-IV-2013	100,00	2,125	3.300			
438054		15-IX-2019	99,78	1,175	1.515			
433252		1-II-2011	100,33	1,875	2.750			
436104		1-VIII-2018	99,19	2,250	3.300			
Agosto	436555	15-IV-2013	100,00	2,125	2.750	11.945	—	11.945
	421635	15-IX-2012	100,26	0,925	750			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	695			
	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	2.750			
	440497 #	1-IX-2011	99,42	2,125	5.000			
	Settembre	428696	1-VIII-2039	99,98	2,500			
436555		15-IV-2013	100,00	2,125	2.500			
374554		15-IX-2035	99,68	1,175	750			
436104		1-VIII-2018	99,19	2,250	2.750			
440497		1-IX-2011	99,42	2,125	3.300			
Ottobre	422062	15-IV-2012	99,40	2,000	1.017	12.074	—	12.074
	436555	15-IV-2013	100,00	2,125	1.650			
	347233	1-VIII-2013	100,04	2,125	2.282			
	440497	1-IX-2011	99,42	2,125	2.750			
	442395 #	1-III-2019	94,35	2,250	4.375			
	Novembre	335798	1-II-2013	100,20	2,375			
393465		1-II-2037	101,28	2,000	1.650			
428696		1-VIII-2039	99,98	2,500	1.566			

1) Riacquistato con l'asta di concambio del 9-V-2008 al prezzo di 100,45. - 2) Asta di concambio del 9-V-2008. - 3) Collocato presso gli investitori da un consorzio di banche al prezzo di 99,786.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Dicembre	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	1.100	13.148	1.255	11.893				
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	376							
	440497	1-IX-2011	99,42	2,125	1.570							
	442395	1-III-2019	94,35	2,250	3.753							
	1) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	2.104							
Dicembre	2) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050	- 794	13.148	1.255	11.893				
	3) 408524	15-VI-2009	100,13	1,875	- 461							
Totali	361838	1-VIII-2014	99,20	2,125	1.447	157.554	98.804	58.750				
	422062	15-IV-2012	99,40	2,000	1.033							
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	1.402							
	4) 428433	15-X-2012	99,85	2,125	1.923							
	440497	1-IX-2011	99,42	2,125	2.013							
	442395	1-III-2019	94,35	2,250	3.226							
	2009											
	Gennaio	127851	1-XI-2029	99,70	2,625				1.679	16.541	—	16.541
		428696	1-VIII-2039	99,98	2,500				1.603			
		444886 #	15-XII-2013	99,64	1,875				5.000			
374554		15-IX-2035	99,68	1,175	550							
438054		15-IX-2019	99,78	1,175	1.100							
440497		1-IX-2011	99,42	2,125	3.564							
Febbraio	442395	1-III-2019	94,35	2,250	3.075	17.362	16.370	992				
	127851	1-XI-2029	99,70	2,625	956							
	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	880							
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	2							
	444886	15-XII-2013	99,64	1,875	3.731							
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	749							
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	980							
	442395	1-III-2019	94,35	2,250	3.814							
	446748 #	1-III-2012	100,22	1,500	6.250							
	Marzo	353515	1-VIII-2034	98,10	2,500				1.521	17.507	—	17.507
401958		1-VIII-2016	100,36	1,875	1.228							
428696		1-VIII-2039	99,98	2,500	1.611							
444886		15-XII-2013	99,64	1,875	3.850							

1) Asta di concambio dell'1-XII-2008. - 2) Riacquistato con l'asta di concambio dell'1-XII-2008 al prezzo di 90,90. - 3) Riacquistato con l'asta di concambio del 1-XII-2008 al prezzo di 100,69. - 4) Asta di concambio del 18-XII-2008.

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Aprile.....	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	527	22.695	15.259	7.436
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	1.020			
	442395	1-III-2019	94,35	2,250	4.400			
	446748	1-III-2012	100,22	1,500	3.350			
	127851	1-XI-2029	99,70	2,625	1.486			
	349325	1-II-2019	99,16	2,125	1.632			
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	3.191			
	444886	15-XII-2013	99,64	1,875	3.850			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	951			
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	900			
Maggio.....	446748	1-III-2012	100,22	1,500	3.810	17.312	22.084	-4.772
	448961 #	1-IX-2019	99,20	2,125	6.875			
	384453	1-VIII-2015	101,79	1,875	1.308			
	428696	1-VIII-2039	99,98	2,500	2.729			
	444886	15-XII-2013	99,64	1,875	3.575			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	2.000			
	446748	1-III-2012	100,22	1,500	2.750			
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	4.950			
Giugno.....	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	1.480	14.371	16.943	-2.572
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	2.475			
	450507 #	1-VI-2014	100,00	1,750	6.026			
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	1.640			
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	2.750			
	Luglio.....	450897 #	1-VII-2012	100,15	1,250			
451364 #		1-III-2025	99,01	2,500	5.500			
424351		15-IX-2023	99,09	1,300	1.308			
448961		1-IX-2019	99,20	2,125	3.850			
450897		1-VII-2012	100,15	1,250	3.545			
Agosto.....	450507	1-VI-2014	100,00	1,750	7.476	15.622	—	15.622
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	996			
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	3.850			
	450897	1-VII-2012	100,15	1,250	3.300			
	Settembre.....	453255 #	1-IX-2040	98,18	2,500			
450507		1-VI-2014	100,00	1,750	2.918			
451364		1-III-2025	99,01	2,500	2.200			
450897		1-VII-2012	100,15	1,250	2.411			
453694 #		1-III-2020	101,92	2,125	6.250			

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Ottobre.....	450507	1-VI-2014	100,00	1,750	3.000	15.459	—	15.459
	451364	1-III-2025	99,01	2,500	2.000			
	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.500			
	454589 #	15-IX-2041	98,89	1,275	3.500			
	450897	1-VII-2012	100,15	1,250	2.565			
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	2.894			
Novembre.....	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	2.000	4.925	23.451	-18.526
	1) 144861	1-XI-2010	100,65	2,750	-72			
	2) 380599	15-IX-2010	99,90	0,475	-486			
	3) 387292	15-VI-2010	100,57	1,375	-882			
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	2.925			
Dicembre.....	453694	1-III-2020	101,92	2,125	3.563	3.563	—	3.563
Totali.....					184.842	94.107	90.735	
2010								
Gennaio.....	456463 #	15-XII-2012	99,47	1,000	4.664	23.187	16.027	7.160
	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	3.621			
	456827 #	15-IV-2015	100,00	1,500	5.839			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.025			
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	650			
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	3.850			
Febbraio.....	456463	15-XII-2012	99,47	1,000	3.538	10.154	—	10.154
	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	1.901			
	451364	1-III-2025	99,01	2,500	2.591			
	456827	15-IV-2015	100,00	1,500	1.150			
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	1.212			
Marzo.....	453694	1-III-2020	101,92	2,125	3.300	24.358	15.450	8.908
	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.500			
	456827	15-IV-2015	100,00	1,500	6.550			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	1.991			
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	384			
	456463	15-XII-2012	99,47	1,000	7.683			
	459493 #	1-IX-2020	100,70	2,000	6.250			

1) Riacquistato al prezzo di 104,36 con l'asta di concambio del 18-XI-2009. Titolo offerto in asta: BTP 2004-2014 4,25% (codice IT0003618383). - 2) Riacquistato al prezzo di 101,10 con l'asta di concambio del 18-XI-2009. Titolo offerto in asta: BTP 2004-2014 4,25% (codice: IT0003618383). - 3) Riacquistato al prezzo di 101,18 con l'asta di concambio del 18-XI-2009. Titolo offerto in asta BTP 2004-2014 4,25% (codice IT0003618383).

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Aprile.....	451364	1-III-2025	99,01	2,500	2.730	16.722	—	16.722
	456827	15-IV-2015	100,00	1,500	3.842			
	460467 #	15-IX-2021	99,33	1,050	3.000			
	456463	15-XII-2012	99,47	1,000	3.300			
	459493	1-IX-2020	100,70	2,000	3.850			
Maggio	451364	1-III-2025	99,01	2,500	2.200	12.204	1.296	10.908
	456827	15-IV-2015	100,00	1,500	3.022			
	1) 308040	1-VIII-2011	101,20	2,625	-354			
	2) 319091	1-II-2012	102,56	2,500	-621			
	3) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	1.290			
	4) 433252	1-II-2011	100,33	1,875	-66			
	5) 440497	1-IX-2011	99,42	2,125	-254			
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	513			
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	1.078			
	461217 #	1-VI-2013	99,02	1,000	4.101			
Giugno.....	393465	1-II-2037	101,28	2,000	1.261	20.168	16.873	3.295
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	1.738			
	461591 #	15-VI-2015	100,50	1,500	4.000			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.528			
	459493	1-IX-2020	100,70	2,000	7.962			
	461217	1-VI-2013	99,02	1,000	3.679			
	Luglio	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375			
453255		1-IX-2040	98,18	2,500	1.727			
461591		15-VI-2015	100,50	1,500	3.275			
454589		15-IX-2041	98,89	1,275	539			
460467		15-IX-2021	99,33	1,050	1.111			
6) 411281		15-IX-2011	100,17	1,875	-419			
7) 446748		1-III-2012	100,22	1,500	-373			
459493		1-IX-2020	100,70	2,000	3.850			
461217		1-VI-2013	99,02	1,000	3.469			
Agosto		451364	1-III-2025	99,01	2,500	2.596	15.673	17.875
	461591	15-VI-2015	100,50	1,500	3.666			
	461217	1-VI-2013	99,02	1,000	3.161			
	463413 #	1-III-2021	99,83	1,875	6.250			
Settembre.....	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	2.200	19.965	13.814	6.151
	461591	15-VI-2015	100,50	1,500	3.850			
	464473 #	1-IX-2026	100,07	2,250	6.000			

1) Riacquistato al prezzo di 104,53 con l'asta di concambio del 20-V-2010. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747). - 2) Riacquistato al prezzo di 105,74 con l'asta di concambio del 20-V-2010. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747). - 3) Asta di concambio del 20-V-2010. - 4) Riacquistato al prezzo di 101,92 con l'asta di concambio del 20-V-2010. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747). - 5) Riacquistato al prezzo di 103,48 con l'asta di concambio del 20-V-2010. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747). - 6) Riacquistato al prezzo di 102,61 con l'asta di concambio del 29-VII-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 7) Riacquistato al prezzo di 102 con l'asta di concambio del 29-VII-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305).

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Ottobre	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.408	15.934	—	15.934				
	461217	1-VI-2013	99,02	1,000	3.207							
	463413	1-III-2021	99,83	1,875	3.300							
	393465	1-II-2037	101,28	2,000	1.154							
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	845							
	461591	15-VI-2015	100,50	1,500	3.850							
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	826							
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	684							
	463413	1-III-2021	99,83	1,875	3.575							
	465310 #	1-XI-2013	99,85	1,125	5.000							
Novembre.....	353515	1-VIII-2034	98,10	2,500	1.319	14.917	21.377	-6.460				
	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	2.475							
	465627 #	1-XI-2015	99,01	1,500	5.625							
	1) 41128	15-IX-2011	100,17	1,875	-322							
	2) 446748	1-III-2012	100,22	1,500	-575							
	3) 450897	1-VII-2012	100,15	1,250	-51							
	463413	1-III-2021	99,83	1,875	2.998							
	465310	1-XI-2013	99,85	1,125	2.500							
	Dicembre	463413	1-III-2021	99,83	1,875				3.300	6.600	4) 5) 720	5.880
		465310	1-XI-2013	99,85	1,125				3.300			
Totali.....					195.608	104.224	91.384					
2011												
Gennaio.....	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	3.300	16.858	—	16.858				
	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	3.300							
	468210 #	15-IX-2016	99,50	1,050	2.833							
	463413	1-III-2021	99,83	1,875	3.575							
	465310	1-XI-2013	99,85	1,125	3.850							
Febbraio	6) 319091	1-II-2012	102,56	2,500	-529	18.119	20.313	-2.194				
	7) 422062	15-IV-2012	99,40	2,000	-229							
	8) 427349	1-II-2018	99,98	2,250	2.170							
	9) 446748	1-III-2012	100,22	1,500	-418							
	10) 461217	1-VI-2013	99,02	1,000	-452							
	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.676							

1) 8 Riacquistato al prezzo di 101,63 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 2) Riacquistato al prezzo di 101,25 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 3) Riacquistato al prezzo di 100,4 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 4) Di cui 220 milioni riacquistati tramite asta a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 5) Per riacquisto tramite asta, mediante intermediari individuati tra gli specialisti in titoli di Stato, a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 6) Riacquistato al prezzo di 103,04 con l'asta di concambio dell'8-II-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2007-2018 4,5% (codice IT0004273493). - 7) Riacquistato al prezzo di 102,35 con l'asta di concambio dell'8-IV-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2007-2018 4,5% (codice IT0004273493). - 8) Asta di concambio dell'8-II-2011. - 9) Riacquistato al prezzo di 101,17 con l'asta di concambio dell'8-II-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2007-2018 4,5% (codice IT0004273493). - 10) Riacquistato al prezzo di 98,2 con l'asta di concambio dell'8-II-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2007-2018 4,5% (codice IT0004273493).

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	3.500	14.737	16.438	-1.701
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.457			
	465310	1-XI-2013	99,85	1,125	3.168			
	469507 #	1-III-2021	99,73	2,375	6.148			
Marzo.....	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	2.184	14.737	16.438	-1.701
	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	3.111			
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	1.728			
	469507	1-III-2021	99,73	2,375	3.250			
	470799 #	1-IV-2014	99,40	1,500	4.464			
Aprile.....	1) 319091	1-II-2012	102,56	2,500	-836	15.620	1.592	14.028
	2) 422062	15-IV-2012	99,40	2,000	-440			
	3) 436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	2			
	4) 446748	1-III-2012	100,22	1,500	-314			
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	1.539			
	471274 #	15-IV-2016	99,79	1,875	4.888			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	652			
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	1.272			
	469507	1-III-2021	99,73	2,375	3.704			
	470799	1-IV-2014	99,40	1,500	3.563			
Maggio.....	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.788	14.036	—	14.036
	471274	15-IV-2016	99,79	1,875	3.648			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.500			
	469507	1-III-2021	99,73	2,375	3.250			
	470799	1-IV-2014	99,40	1,500	3.850			
Giugno.....	473515 #	15-IX-2026	100,00	1,550	3.000	12.719	—	12.719
	471274	15-IV-2016	99,79	1,875	3.500			
	469507	1-III-2021	99,73	2,375	3.300			
	470799	1-IV-2014	99,40	1,500	2.919			
Luglio.....	416477	1-II-2017	98,95	2,000	763	12.102	—	12.102
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	1.236			
	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	1.715			
	471274	15-IV-2016	99,79	1,875	1.250			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	942			
	469507	1-III-2021	99,73	2,375	2.696			
475040 #	1-VII-2014	98,67	2,125	3.500				

1) Riacquistato al prezzo di 102,66 con l'asta di concambio del 5-IV-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2018 4,5% (codice IT0004361041). - 2) Riacquistato al prezzo di 102,11 con l'asta di concambio del 5-IV-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2018 4,5% (codice IT0004361041). - 3) Asta di concambio del 5-IV-2011. - 4) Riacquistato al prezzo di 101,09 con l'asta di concambio del 5-IV-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2018 4,5% (codice IT0004361041).

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Agosto.....	475040	1-VII-2014	98,67	2,125	3.040	6.791	20.196	-13.405
	475967 #	1-III-2022	98,75	2,500	3.751			
Settembre.....	364476	1-II-2020	99,66	2,250	813	14.702	34.710	-20.008
	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	756			
	459493	1-IX-2020	100,70	2,000	1.311			
	476195 #	15-IX-2016	96,65	2,375	4.864			
	1) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050	-664			
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	750			
	475040	1-VII-2014	98,67	2,125	3.486			
475967	1-III-2022	98,75	2,500	2.722				
Ottobre.....	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	646	15.319	822	14.497
	451364	1-III-2025	99,01	2,500	1.033			
	469507	1-III-2021	99,73	2,375	1.273			
	476195	15-IX-2016	96,65	2,375	3.850			
	4) 347233	1-VIII-2013	100,04	2,125	-466			
	5) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050	-356			
	6) 471274	15-IV-2016	99,79	1,875	1.585			
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	870			
	475040	1-VII-2014	98,67	2,125	3.083			
	475967	1-III-2022	98,75	2,500	2.979			
Novembre.....	476195	15-IX-2016	96,65	2,375	3.000	12.446	27	12.419
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	623			
	459493	1-IX-2020	100,70	2,000	1.698			
	475967	1-III-2022	98,75	2,500	2.750			
	478038 #	15-XI-2014	95,45	3,000	4.375			
Dicembre.....	7) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	740	10.928	414	10.514
	8) 422062	15-IV-2012	99,40	2,000	-414			
	476195	15-IX-2016	96,65	2,375	3.300			
	469507	1-III-2021	99,73	2,375	1.362			
	475967	1-III-2022	98,75	2,500	2.750			
	478038	15-XI-2014	95,45	3,000	2.776			
Totali.....					164.377	94.512	69.865	
2012								
Gennaio.....	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	971	13.612	—	13.612
	475040	1-VII-2014	98,67	2,125	778			
	478038	15-XI-2014	95,45	3,000	3.000			

1) Riacquistato al prezzo di 87,65 con l'asta di concambio del 21-IX-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2019 4,5% (codice IT0004423957). - 2) Di cui euro 652 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 3) Di cui euro 447 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 4) Riacquistato al prezzo di 99,8 con l'asta di concambio del 19-X-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2016 3,75% (codice IT0004712748). - 5) Riacquistato al prezzo di 88,55 con l'asta di concambio del 19-X-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2016 3,75% (codice IT0004712748). - 6) Asta di concambio del 19-X-2011. - 7) Asta di concambio del 7-XII-2011. - 8) Riacquistato al prezzo di 99,58 con l'asta di concambio del 7-XII-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747).

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Febbraio	463413	1-III-2021	99,83	1,875	1.270	15.395	25.807	- 10.412				
	471274	15-IV-2016	99,79	1,875	820							
	475967	1-III-2022	98,75	2,500	2.200							
	479347 #	1-V-2017	97,40	2,375	4.573							
	416477	1-II-2017	98,95	2,000	1.388							
	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	723							
	478038	15-XI-2014	95,45	3,000	4.343							
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	746							
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	758							
	479347	1-V-2017	97,40	2,375	2.750							
Marzo.....	480154 #	1-III-2022	100,00	2,750	4.687	20.013	14.871	5.142				
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	1.100							
	480507 #	1-III-2015	99,32	1,250	5.872							
	480688 #	26-III-2016	100,00	1,225	7.291							
	479347	1-V-2017	97,40	2,375	2.500							
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	3.250							
Aprile.....	364476	1-II-2020	99,66	2,250	755	13.470	15.064	- 1.594				
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	1.009							
	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	434							
	480507	1-III-2015	99,32	1,250	3.184							
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	551							
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	990							
	349325	1-II-2019	99,16	2,125	590							
	471274	15-IV-2016	99,79	1,875	541							
	479347	1-V-2017	97,40	2,375	2.666							
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	2.750							
Maggio	451364	1-III-2025	99,01	2,500	557	12.863	—	12.863				
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	543							
	475967	1-III-2022	98,75	2,500	651							
	480507 #	1-III-2015	99,32	1,250	3.501							
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	417							
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	2.753							
	482042 #	1-VI-2017	96,40	2,375	4.441							
	Giugno.....	482143 #	11-VI-2016	100,00	1,775				1.738	14.073	—	14.073
		349325	1-II-2019	99,16	2,125				720			
		453694	1-III-2020	101,92	2,125				1.004			
480507		1-III-2015	99,32	1,250	3.450							
468210		15-IX-2016	99,50	1,050	625							

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Luglio	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	289	7.343	18.065	- 10.722
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	3.372			
	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	2.875			
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	383			
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	766			
	475967	1-III-2022	98,75	2,500	600			
	484078 #	15-VII-2015	99,72	2,250	4.421			
	1) 374554	15-IX-2035	99,68	1,175	-607			
	2) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050	17			
	3) 424351	15-IX-2023	99,09	1,300	-325			
Agosto.....	4) 438054	15-IX-2019	99,78	1,175	-77	14.159	—	14.159
	5) 479347	1-V-2017	97,40	2,375	1.156			
	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	752			
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	2.772			
	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	2.450			
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	311			
Settembre	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	483	9.755	10.438	- 683
	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	2.875			
	484883 #	1-XI-2022	98,20	2,750	4.516			
	324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	1.070			
	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	1.725			
	484078	15-VII-2015	99,72	2,250	4.216			
Ottobre	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.741	40.998	18.373	22.625
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	1.003			
	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	3.167			
	484883	1-XI-2022	98,20	2,750	3.377			
	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	817			
	451364	1-III-2025	99,01	2,500	797			
	476195	15-IX-2016	96,65	2,375	973			
	484078	15-VII-2015	99,72	2,250	4.312			
	486360 #	22-X-2016	100,00	1,275	18.017			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	674			
Novembre.....	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	326	12.944	—	12.944
	484883	1-XI-2022	98,20	2,750	3.394			
	486707 #	1-XI-2017	98,80	1,750	5.144			
	127851	1-XI-2029	99,70	2,625	763			
	435684	1-VIII-2023	99,13	2,375	938			
	484078	15-VII-2015	99,72	2,250	3.955			

1) Riacquistato al prezzo di 61,75 con l'asta di concambio del 25-VII-2012. Titolo offerto in asta: BTP 2012-2017 4,75% (codice IT0004793474). - 2) Riacquistato al prezzo di 85,95 con l'asta di concambio del 25-VII-2012. Titolo offerto in asta: BTP 2012-2017 4,75% (codice IT0004793474). - 3) Riacquistato al prezzo di 75,2 con l'asta di concambio del 25-VII-2012. Titolo offerto in asta: BTP 2012-2017 4,75% (codice IT0004793474). - 4) Riacquistato al prezzo di 82 con l'asta di concambio del 25-VII-2012. Titolo offerto in asta: BTP 2012-2017 4,75% (codice IT0004793474). - 5) Asta di concambio del 25-VII-2012.

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Dicembre	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	859	5.385	18.685	-13.300
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	290			
	484883	1-XI-2022	98,20	2,750	3.139			
	486707	1-XI-2017	98,80	1,750	3.000			
	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	841			
	488099 #	1-XII-2015	100,75	1,375	4.544			
Totali					180.010	121.303	58.707	
2013								
Gennaio.....	484883	1-XI-2022	98,20	2,750	3.450	25.701	—	25.701
	486707	1-XI-2017	98,80	1,750	3.320			
	488099	1-XII-2015	100,75	1,375	3.500			
	488903 #	1-IX-2028	100,01	2,375	6.000			
	489088 #	15-IX-2018	99,50	0,850	2.931			
	484883	1-XI-2022	98,20	2,750	3.500			
Febbraio	486707	1-XI-2017	98,80	1,750	3.000	15.309	21.008	-5.699
	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.020			
	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	991			
	488099	1-XII-2015	100,75	1,375	3.973			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	941			
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	309			
Marzo.....	486707	1-XI-2017	98,80	1,750	2.875	14.455	1) 2) 1.845	12.610
	489803 #	1-V-2023	97,81	2,250	5.200			
	488099	1-XII-2015	100,75	1,375	3.848			
	488903	1-IX-2028	100,01	2,375	2.000			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	383			
	489088	15-IX-2018	99,50	0,850	616			
Aprile.....	489803	1-V-2023	97,81	2,250	3.095	30.373	16.700	13.673
	490784 #	1-VI-2018	99,44	1,750	4.513			
	488903	1-IX-2028	100,01	2,375	1.668			
	491779 #	15-V-2016	99,91	1,125	4.000			
	491795 #	22-IV-2017	100,00	1,125	17.056			
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	750			
489803	1-V-2023	97,81	2,250	3.449	3.450			
	490784	1-VI-2018	99,44	1,750				

1) Di cui euro 570 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 2) Di cui euro 1.275 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Maggio	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	1.500	17.579	—	17.579				
	491779	15-V-2016	99,91	1,125	3.500							
	492399 #	1-IX-2044	97,22	2,375	6.000							
	489088	15-IX-2018	99,50	0,850	987							
	489803	1-V-2023	97,81	2,250	3.450							
	490784	1-VI-2018	99,44	1,750	2.142							
Giugno.....	488903	1-IX-2028	100,01	2,375	1.725	10.584	17.166	-6.582				
	491779	15-V-2016	99,91	1,125	3.940							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	563							
	489088	15-IX-2018	99,50	0,850	586							
	489803	1-V-2023	97,81	2,250	2.875							
	490784	1-VI-2018	99,44	1,750	895							
Luglio	491779	15-V-2016	99,91	1,125	3.388	16.162	—	16.162				
	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	1.461							
	490784	1-VI-2018	99,44	1,750	6.450							
	495341 #	1-VIII-2024	100,77	2,250	4.863							
	Agosto.....	473515	15-IX-2026	100,00	1,550				294	8.139	24.695	-16.556
		489088	15-IX-2018	99,50	0,850				780			
495341		1-VIII-2024	100,77	2,250	2.750							
495757 #		1-XII-2018	100,71	1,750	4.315							
Settembre	488903	1-IX-2028	100,01	2,375	1.642	13.319	—	13.319				
	496082 #	15-XI-2016	100,16	1,375	4.927							
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	750							
	495341	1-VIII-2024	100,77	2,250	3.000							
	495757	1-XII-2018	100,71	1,750	3.000							
	Ottobre	496640 #	1-V-2021	100,13	1,875				5.000	17.362	—	17.362
488903		1-IX-2028	100,01	2,375	1.437							
496082		15-XI-2016	100,16	1,375	4.025							
495341		1-VIII-2024	100,77	2,250	3.450							
495757		1-XII-2018	100,71	1,750	3.450							
Novembre.....		496920 #	12-XI-2017	100,00	1,075	22.271	33.598	1) 20.126	13.472			
	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	1.692							
	496082	15-XI-2016	100,16	1,375	3.450							
	2) 456827	15-IV-2015	100,00	1,500	-712							
	3) 461591	15-VI-2015	100,50	1,500	-644							
	4) 488099	1-XII-2015	100,75	1,375	-951							

1) Di cui Euro 5,6 miliardi di rimborsi a scadenza mediante utilizzo del Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 2) Riacquistato al prezzo di 102,86 con l'asta di concambio del 18-XI-2013. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 3) Riacquistato al prezzo di 103 con l'asta di concambio del 18-XI-2013. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 4) Riacquistato al prezzo di 102,95 con l'asta di concambio del 18-XI-2013. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574).

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Dicembre	1) 495757	1-XII-2018	100,71	1,750	3.310	6.325	2)3)4)22917	-16.592				
	495341	1-VIII-2024	100,77	2,250	2.875							
	495341	1-VIII-2024	100,77	2,250	2.875							
	495757	1-XII-2018	100,71	1,750	3.450							
Totali.....					208.906	124.457	84.449					
2014												
Gennaio.....	488903	1-IX-2028	100,01	2,375	1.957	19.539	—	19.539				
	496640	1-V-2021	100,13	1,875	2.875							
	498719 #	15-XII-2016	100,00	0,750	4.807							
	489088	15-IX-2018	99,50	0,850	1.250							
	495341	1-VIII-2024	100,77	2,250	3.450							
	499230 #	1-V-2019	100,40	1,250	5.200							
	Febbraio	492399	1-IX-2044	97,22	2,375				1.725	19.711	1.526	18.185
		496640	1-V-2021	100,13	1,875				2.875			
		498719	15-XII-2016	100,00	0,750				4.025			
		5) 371991	1-II-2015	100,43	2,125				-373			
6) 461591		15-VI-2015	100,50	1,500	-466							
7) 490784		1-VI-2018	99,44	1,750	2.500							
8) 384453		1-VIII-2015	101,79	1,875	-686							
489088		15-IX-2018	99,50	0,850	1.150							
499230		1-V-2019	100,40	1,250	3.186							
500154 #		1-IX-2024	103,11	1,875	4.250							
Marzo.....	500442 #	15-IX-2024	99,75	1,175	4.500	19.709	—	19.709				
	393465	1-II-2037	101,28	2,000	826							
	488903	1-IX-2028	100,01	2,375	1.725							
	496640	1-V-2021	100,13	1,875	2.300							
	498719	15-XII-2016	100,00	0,750	3.608							
	499230	1-V-2019	100,40	1,250	3.000							
	500154	1-IX-2024	103,11	1,875	3.750							
	Aprile.....	498719	15-XII-2016	100,00	0,750				3.564	16.745	14.797	1.948
		492399	1-IX-2044	97,22	2,375				1.412			
		496640	1-V-2021	100,13	1,875				2.760			
501278 #		23-IV-2020	100,00	0,825	20							
473515		15-IX-2026	100,00	1,550	540							

1) Asta di concambio del 18-XI-2013. - 2) Di cui Euro 303 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 3) Di cui Euro 1.190 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 4) Di cui Euro 1.418 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 5) Riacquisito al prezzo di 103,415 con l'asta di concambio del 17-II-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004907843). - 6) Riacquisito al prezzo di 102,98 con l'asta di concambio del 17-II-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004907843). - 7) Asta di concambio del 17-II-2014. - 8) Riacquisito al prezzo di 104,29 con l'asta di concambio del 17-II-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004907843).

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Maggio	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	974	25.295	1.593	23.702				
	499230	1-V-2019	100,40	1,250	4.025							
	500154	1-IX-2024	103,11	1,875	3.450							
	353515	1-VIII-2034	98,10	2,500	451							
	393465	1-II-2037	101,28	2,000	698							
	496640	1-V-2021	100,13	1,875	2.587							
	502345 #	15-V-2017	100,25	0,575	5.200							
	502423 #	1-III-2030	99,47	1,750	7.000							
	1) 384453	1-VIII-2015	101,79	1,875	-450							
	2) 456827	15-IV-2015	100,00	1,500	-677							
3) 488099	1-XII-2015	100,75	1,375	-464								
4) 495757	1-XII-2018	100,71	1,750	2.323								
489088	15-IX-2018	99,50	0,850	1.131								
499230	1-V-2019	100,40	1,250	2.904								
500154	1-IX-2024	103,11	1,875	3.001								
Giugno.....	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	1.150	21.134	20.643	491				
	502345	15-V-2017	100,25	0,575	4.025							
	502800 #	15-XII-2021	100,27	1,075	4.936							
	5) 416477	1-II-2017	98,95	2,000	-397							
	6) 461591	15-VI-2015	100,50	1,500	-604							
	7) 465627	1-XI-2015	99,01	1,500	-115							
	8) 475967	1-III-2022	98,75	2,500	2.230							
	9) 484078	15-VII-2015	99,72	2,250	-104							
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	1.150							
	500154	1-IX-2024	103,11	1,875	2.875							
503050 #	1-VIII-2019	100,74	0,750	4.768								
Luglio	502345	15-V-2017	100,25	0,575	3.450	15.274	10) 13.890	1.384				
	502423	1-III-2030	99,47	1,750	2.300							
	502800	15-XII-2021	100,27	1,075	2.875							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	511							
	489088	15-IX-2018	99,50	0,850	638							
	500154	1-IX-2024	103,11	1,875	2.500							
	503050	1-VIII-2019	100,74	0,750	3.000							
	Agosto.....	503050	1-VIII-2019	100,74	0,750				2.875	6.875	27.249	-20.374
		504527 #	1-XII-2024	101,14	1,250				4.000			
	Settembre	502345	15-V-2017	100,25	0,575				2.457	14.772	14.500	272
502423		1-III-2030	99,47	1,750	2.000							
502800		15-XII-2021	100,27	1,075	2.500							

1) Riacquisito al prezzo di 103,43 con l'asta di concambio del 21-V-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 2) Riacquisito al prezzo di 101,97 con l'asta di concambio del 21-V-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 3) Riacquisito al prezzo di 102,71 con l'asta di concambio del 21-V-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 4) Asta di concambio del 21-V-2014. - 5) Riacquisito al prezzo di 107,97 con l'asta di concambio del 20-VI-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2022 5% (codice IT0004759673). - 6) Riacquisito al prezzo di 102,489 con l'asta di concambio del 20-VI-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2022 5% (codice IT0004759673). - 7) Riacquisito al prezzo di 103,344 con l'asta di concambio del 20-VI-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2022 5% (codice IT0004759673). - 8) Asta di concambio del 20-VI-2014. - 9) Riacquisito al prezzo di 104,232 con l'asta di concambio del 20-VI-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2022 5% (codice IT0004759673). - 10) Di cui Euro 393 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato.

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Ottobre	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	524	22.557	1.004	21.553				
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	966							
	503050	1-VIII-2019	100,74	0,750	2.875							
	504527	1-XII-2024	101,14	1,250	3.450							
	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	1.437							
	502800	15-XII-2021	100,27	1,075	2.300							
	505846 #	15-I-2018	100,00	0,375	4.128							
	1) 384453	1-VIII-2015	101,79	1,875	-702							
	2) 416477	1-II-2017	98,95	2,000	-302							
	505890 #	27-X-2020	100,00	0,625	7.506							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	484							
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	665							
	503050	1-VIII-2019	100,74	0,750	2.875							
	504527	1-XII-2024	101,14	1,250	3.162							
	Novembre.....	502423	1-III-2030	99,47	1,750				1.500	12.301	3) 14.491	-2.190
		502800	15-XII-2021	100,27	1,075				2.171			
		505846	15-I-2018	100,00	0,375				2.780			
504527		1-XII-2024	101,14	1,250	2.300							
506939 #		1-XII-2019	100,53	0,525	3.550							
Dicembre	504527	1-XII-2024	101,14	1,250	3.445	6.740	4)5)6) 2.798	3.942				
	506939	1-XII-2019	100,53	0,525	3.295							
Totali.....					200.652	112.491	88.161					
2015												
Gennaio.....	502423	1-III-2030	99,47	1,750	1.500	22.799	—	22.799				
	502800	15-XII-2021	100,27	1,075	2.875							
	505846	15-I-2018	100,00	0,375	3.450							
	508305 #	1-IX-2046	99,70	1,625	6.500							
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	307							
	489088	15-IX-2018	99,50	0,850	692							
	504527	1-XII-2024	101,14	1,250	4.025							
	506939	1-XII-2019	100,53	0,525	3.450							

1) Riacquistato al prezzo di 102,52 con l'asta di concambio del 16-X-2014. Titolo offerto in asta: BTP 1993-2023 9% (codice IT0000366655). - 2) Riacquistato al prezzo di 107,38 con l'asta di concambio del 16-X-2014. Titolo offerto in asta: BTP 1993-2023 9% (codice IT0000366655). - 3) Di cui Euro 3,671 miliardi riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 4) Di cui Euro 907 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 5) Di cui Euro 1.079 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 6) Di cui Euro 812 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Febbraio	502423	1-III-2030	99,47	1,750	1.725	19.675	20.976	-1.301				
	505846	15-I-2018	100,00	0,375	2.875							
	508688 #	15-IV-2022	100,80	0,675	5.200							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	1.150							
	506939	1-XII-2019	100,53	0,525	2.875							
	509031 #	1-VI-2025	101,40	0,750	5.850							
Marzo.....	505846	15-I-2018	100,00	0,375	2.500	21.929	12.408	9.521				
	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	1.750							
	508688	15-IV-2022	100,80	0,675	3.000							
	509408 #	1-III-2032	99,50	0,825	8.000							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	525							
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	979							
	506939	1-XII-2019	100,53	0,525	2.300							
	509031	1-VI-2025	101,40	0,750	2.875							
	Aprile.....	502423	1-III-2030	99,47	1,750				1.500	25.570	18.903	6.667
		508688	15-IV-2022	100,80	0,675				2.500			
510604 #		15-V-2018	100,07	0,125	3.530							
1) 324274		1-VIII-2017	98,34	2,625	-781							
2) 401958		1-VIII-2016	100,36	1,875	-462							
3) 416477		1-II-2017	98,95	2,000	-404							
4) 451364		1-III-2025	99,01	2,500	1.663							
510584 #		20-IV-2023	100,00	0,250	9.379							
460467		15-IX-2021	99,33	1,050	357							
500442		15-IX-2024	99,75	1,175	504							
509031		1-VI-2025	101,40	0,750	2.000							
510770 #		1-V-2020	100,33	0,350	4.137							
Maggio		508305	1-IX-2046	99,70	1,625	750	16.206	—	16.206			
		508688	15-IV-2022	100,80	0,675	2.500						
	509408	1-III-2032	99,50	0,825	749							
	510604	15-V-2018	100,07	0,125	3.087							
	5) 502423	1-III-2030	99,47	1,750	1.574							
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	1.395							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	467							
	509031	1-VI-2025	101,40	0,750	2.875							
	510770	1-V-2020	100,33	0,350	2.809							

1) Riacquistato al prezzo di 111,385 con l'asta di concambio del 17-IV-2015. Titolo offerto in asta: BTP 2009-2025 5% (codice IT0004513641). - 2) Riacquistato al prezzo di 104,71 con l'asta di concambio del 17-IV-2015. Titolo offerto in asta: BTP 2009-2025 5% (codice IT0004513641). - 3) Riacquistato al prezzo di 106,88 con l'asta di concambio del 17-IV-2015. Titolo offerto in asta: BTP 2009-2025 5% (codice IT0004513641). - 4) Asta di concambio del 17-IV-2015. - 5) Asta di concambio del 21-VII-2015.

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Giugno.....	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	946	12.731	16.927	-4.196
	508688	15-IV-2022	100,80	0,675	2.300			
	509408	1-III-2032	99,50	0,825	778			
	510604	15-V-2018	100,07	0,125	2.502			
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	254			
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	895			
	509031	1-VI-2025	101,40	0,750	3.331			
	510770	1-V-2020	100,33	0,350	1.725			
Luglio	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	1.599	14.345	17.005	-2.660
	508688	15-IV-2022	100,80	0,675	2.284			
	509408	1-III-2032	99,50	0,825	1.725			
	510604	15-V-2018	100,07	0,125	2.857			
	1) 401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	-345			
	2) 482042	1-VI-2017	96,40	2,375	-222			
	3) 486707	1-XI-2017	98,80	1,750	-377			
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	817			
	509031	1-VI-2025	101,40	0,750	2.855			
	510770	1-V-2020	100,33	0,350	2.208			
	Agosto.....	510770	1-V-2020	100,33	0,350			
512708 #		1-XII-2025	100,51	1,000	4.474			
Settembre.....	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	1.695	15.814	745	15.069
	510604	15-V-2018	100,07	0,125	2.269			
	513584 #	15-IX-2022	100,54	0,725	5.015			
	4) 498719	15-XII-2016	100,00	0,750	-440			
	5) 502345	15-V-2017	100,25	0,575	-305			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	563			
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	522			
	510770	1-V-2020	100,33	0,350	2.300			
	512708	1-XII-2025	100,51	1,000	3.450			
	Ottobre	513882 #	15-IX-2032	99,77	0,625			
509408		1-III-2032	99,50	0,825	1.150			
513584		15-IX-2022	100,54	0,725	2.875			
513909 #		15-X-2018	100,15	0,150	3.691			
512708		1-XII-2025	100,51	1,000	2.180			
514214 #		1-XI-2020	100,57	0,325	4.000			

1) Riacquistato al prezzo di 103,81 con l'asta di concambio del 17-VII-2015. Titolo offerto in asta BTP 2014-2030 3,5% (codice IT0005024234). - 2) Riacquistato al prezzo di 108,53 con l'asta di concambio del 17-VII-2015. Titolo offerto in asta BTP 2014-2030 3,5% (codice IT0005024234). - 3) Riacquistato al prezzo di 107,385 con l'asta di concambio del 17-VII-2015. Titolo offerto in asta BTP 2014-2020 (codice IT0005024234). - 4) Riacquistato al prezzo di 101,76 con l'asta di concambio del 16-IX-2015. Titolo offerto in asta CCT 2014-2020 (codice IT0005056541). - 5) Riacquistato al prezzo di 101,69 con l'asta di concambio del 16-IX-2015. Titolo offerto in asta CCT 2014-2020 (codice IT0005056541). - 6) Di cui Euro 3,9 miliardi di rimborsi a scadenza mediante utilizzo del Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
Novembre.....	428696	1-VIII-2039	99,98	2,500	635	11.309	13.385	-2.076				
	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	514							
	513584	15-IX-2022	100,54	0,725	2.789							
	513909	15-X-2018	100,15	0,150	2.160							
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	614							
	513882	15-IX-2032	99,77	0,625	411							
	512708	1-XII-2025	100,51	1,000	1.686							
	514214	1-XI-2020	100,57	0,325	2.500							
	Dicembre	512708	1-XII-2025	100,51	1,000				2.587	4.980	14.451	-9.471
		514214	1-XI-2020	100,57	0,325				2.393			
Totali.....						189.424	142.720	46.704				
2016												
Gennaio.....	509408	1-III-2032	99,50	0,825	2.012	14.648	—	14.648				
	513584	15-IX-2022	100,54	0,725	3.450							
	513909	15-X-2018	100,15	0,150	2.000							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	600							
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	549							
	512708	1-XII-2025	100,51	1,000	3.450							
	514214	1-XI-2020	100,57	0,325	2.587							
Febbraio	516282 #	1-III-2047	99,18	1,350	9.000	23.997	—	23.997				
	502423	1-III-2030	99,47	1,750	1.150							
	513584	15-IX-2022	100,54	0,725	2.875							
	513909	15-X-2018	100,15	0,150	2.239							
	513882	15-IX-2032	99,77	0,625	946							
	514214	1-XI-2020	100,57	0,325	2.587							
	517083 #	1-VI-2026	100,97	0,800	5.200							
Marzo.....	1) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	-627	18.779	8.917	9.862				
	2) 416477	1-II-2017	98,95	2,000	-96							
	3) 427349	1-II-2018	99,98	2,250	-363							
	4) 479347	1-V-2017	97,40	2,375	-538							
	5) 488903	1-IX-2028	100,01	2,375	1.627							

1) Riacquistato al prezzo di 107,447 con l'asta di concambio del 4-III-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 2) Riacquistato al prezzo di 103,88 con l'asta di concambio del 4-III-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 3) Riacquistato al prezzo di 108,68 con l'asta di concambio del 4-III-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 4) Riacquistato al prezzo di 105,53 con l'asta di concambio del 4-III-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 5) Asta di concambio del 4-III-2016.

BUONI DEL TESORO POLIENNALI EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS ISSUED AND

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)				
	509408	1-III-2032	99,50	0,825	1.725							
	513909	15-X-2018	100,15	0,150	2.107							
	517232 #	15-III-2023	101,07	0,475	5.200							
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	292							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	569							
	517083	1-VI-2026	100,97	0,800	3.046							
	517559 #	1-VI-2021	100,55	0,225	4.213							
	Aprile.....	517490 #	11-IV-2024	100,00	0,200				8.014	1) 16.235	12.335	
	502423	1-III-2030	99,47	1,750	706	28.570						
	516282	1-III-2047	99,18	1,350	1.374							
	517232	15-III-2023	101,07	0,475	2.821							
	517727 #	15-IV-2019	100,15	0,050	3.500							
	517790 #	1-IX-2036	99,36	1,125	6.500							
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	862							
	517083	1-VI-2026	100,97	0,800	2.501							
	517559	1-VI-2021	100,55	0,225	2.292							
	Maggio	2) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625				-370	16.273	15.511	762
		3) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050				-205	15.554	3.304	12.250
		4) 486707	1-XI-2017	98,80	1,750				-455			
		5) 502345	15-V-2017	100,25	0,575				-730			
		502423	1-III-2030	99,47	1,750				1.000			
		509408	1-III-2032	99,50	0,825				1.500			
517232		15-III-2023	101,07	0,475	2.722							
517727		15-IV-2019	100,15	0,050	2.547							
518812 #		15-V-2022	99,82	0,050	3.000							
517083		1-VI-2026	100,97	0,800	3.002							
517559		1-VI-2021	100,55	0,225	2.502							
	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	741	15.554	3.304	12.250				
	516282	1-III-2047	99,18	1,350	1.258							
	517232	15-III-2023	101,07	0,475	3.000							
	517727	15-IV-2019	100,15	0,050	2.000							
	6) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	-270							
	7) 427349	1-II-2018	99,98	2,250	-732							
	Giugno.....											

Mese di emissione	Codice ISIN	Scadenza	Prezzo di emissione	Cedola semestrale	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
	1) 489803	1-V-2023	97,81	2,250	2.000			
	2) 490784	1-VI-2018	99,44	1,750	-562			
	513882	15-IX-2032	99,77	0,625	805			
	517083	1-VI-2026	100,97	0,800	2.875			
	517559	1-VI-2021	100,55	0,225	2.875			
Totali.....						117.821	43.967	73.854

1) Di cui Euro 3,7 miliardi di rimborsi a scadenza mediante utilizzo del Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 2) Riacquistato al prezzo di 106,54 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 3) Riacquistato al prezzo di 104,485 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 4) Riacquistato al prezzo di 105,249 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 5) Riacquistato al prezzo di 101,258 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 6) Riacquistato al prezzo di 105,85 con l'asta di concambio del 17-VI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2023 4,50% (codice IT0004898034). - 7) Riacquistato al prezzo di 107,17 con l'asta di concambio del 17-VI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2023 4,50% (codice IT0004898034).

1) Asta di concambio del 17-VI-2016. - 2) Riacquistato al prezzo di 106,65 con l'asta di concambio del 17-VI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2023 4,50% (codice IT0004898034).

CERTIFICATI DI CREDITO EMESSI E RIMBORSATI
TREASURY CREDIT CERTIFICATES ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
2006								
Gennaio	392699	CTZ 28-IX-2007	95,66	—	2.000	3.649	1.180	2.469
	399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	1.649			
Febbraio	392699	CTZ 28-IX-2007	95,66	—	2.500	4.000	—	4.000
	399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	1.500			
Marzo	392699	CTZ 28-IX-2007	95,66	—	2.500	4.150	13.069	-8.919
	399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	1.650			
Aprile	1) 338490	CCT 1-X-2009	101,13	0,15	-270	6.000	12.843	-6.843
	2) 343821	CCT 1-II-2010	101,47	0,15	-147			
	3) 349715	CCT 1-VI-2010	101,37	0,15	-226			
	405105 #	CTZ 30-V-2008	93,41	—	4.000			
	399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	2.000			
Maggio	405105	CTZ 30-V-2008	93,41	—	2.500	4.000	—	4.000
	399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	1.500			
Giugno	405105	CTZ 30-V-2008	93,41	—	2.118	3.618	—	3.618
	399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	1.500			
Luglio	405105	CTZ 30-V-2008	93,41	—	2.200	3.700	12.783	-9.083
	399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	1.500			
Agosto	405105	CTZ 30-V-2008	93,41	—	2.000	5.500	—	5.500
	410144 #	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	3.500			
Settembre	405105	CTZ 30-V-2008	93,41	—	1.500	3.000	—	3.000
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	1.500			
Ottobre	405105	CTZ 30-V-2008	93,41	—	1.650	3.150	—	3.150
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	1.500			
Novembre	4) 349715	CCT 1-VI-2010	101,37	0,15	-217	—	217	-217
Dicembre	416681 #	CTZ 31-XII-2008	92,77	—	3.500	5.000	5) 14.727	-9.727
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	1.500			
Totali					45.767	54.819	-9.052	

1) Riacquistato al prezzo di 100,435 con l'asta di concambio del 3-IV-2006. - 2) Riacquistato al prezzo di 100,41 con l'asta di concambio del 3-IV-2006. - 3) Riacquistato al prezzo di 100,38 con l'asta di concambio del 3-IV-2006. - 4) Riacquistato al prezzo di 100,52 con l'asta di concambio del 30-XI-2006. - 5) Di cui Euro 1.299 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità.

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2005 AL 30 GIUGNO 2015
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2005 AND 30th JUNE 2015

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
2007								
Gennaio	416681	CTZ 31-XII-2008	92,77	—	2.000	4.000	4.639	-639
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	2.000			
Febbraio	416681	CTZ 31-XII-2008	92,77	—	2.750	4.750	—	4.750
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	2.000			
Marzo	1) 316216	CCT 1-IX-2008	100,89	0,15	-178	4.260	178	4.082
	416681	CTZ 31-XII-2008	92,77	—	2.060			
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	2.200			
Aprile	416681	CTZ 31-XII-2008	92,77	—	2.000	5.500	13.201	-7.701
	422404 #	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	3.500			
Maggio	416681	CTZ 31-XII-2008	92,77	—	2.000	4.000	—	4.000
	422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	2.000			
Giugno	424480 #	CTZ 30-VI-2009	91,72	—	4.375	5.875	—	5.875
	422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	1.500			
Luglio	424480	CTZ 30-VI-2009	91,72	—	2.200	3.700	513	3.187
	422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	1.500			
Agosto	424480	CTZ 30-VI-2009	91,72	—	2.200	4.200	10.231	-6.031
	422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	2.000			
Settembre	2) 316216	CCT 1-IX-2008	100,89	0,15	-313	3.510	16.091	-12.581
	3) 321971	CCT 1-VII-2009	100,78	0,15	-101			
	4) 326311	CCT 1-IV-2009	100,93	0,15	-293			
	5) 338490	CCT 1-X-2009	101,13	0,15	-416			
	6) 360538	CCT 1-XII-2010	101,32	0,15	-466			
	424480	CTZ 30-VI-2009	91,72	—	2.010			
Ottobre	422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	1.500	3.650	—	3.650
	424480	CTZ 30-VI-2009	91,72	—	2.000			
Novembre	—	—	—	—	—	—	7) 1.609	-1.609
Dicembre	430761 #	CTZ 31-XII-2009	92,27	—	4.250	5.796	8) 2.885	2.911
	422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	1.546			
Totali					49.241	49.347	-106	

1) Riacquistato al prezzo di 100,375 con l'asta di concambio del 23-III-2007. - 2) Riacquistato al prezzo di 100,21 con l'asta di concambio del 12-IX-2007. - 3) Riacquistato al prezzo di 100,5 con l'asta di concambio del 12-IX-2007. - 4) Riacquistato al prezzo di 100,325 con l'asta di concambio del 12-IX-2007. - 5) Riacquistato al prezzo di 100,49 con l'asta di concambio del 12-IX-2007. - 6) Riacquistato al prezzo di 100,48 con l'asta di concambio del 12-IX-2007. - 7) Di cui Euro 1,609 miliardi riacquistati mediante asta in data 30-XI-2007. - 8) Di cui Euro 2,885 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità.

CERTIFICATI DI CREDITO EMESSI E RIMBORSATI
TREASURY CREDIT CERTIFICATES ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
2008								
Gennaio	430761	CTZ 31-XII-2009	92,27	—	2.500	6.340	—	6.340
	432181 #	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	3.840			
Febbraio	430761	CTZ 31-XII-2009	92,27	—	2.750	4.750	—	4.750
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	2.000			
Marzo	1) 321971	CCT 1-VII-2009	100,78	0,15	-78	3.575	657	2.918
	2) 338490	CCT 1-X-2009	101,13	0,15	-129			
	3) 349715	CCT 1-VI-2010	101,37	0,15	-449			
	430761	CTZ 31-XII-2009	92,27	—	2.200			
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.375			
Aprile	436105 #	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	3.500	4.875	9.592	-4.717
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.375			
Maggio	4) 321971	CCT 1-VII-2009	100,78	0,15	-298	3.260	17.245	-13.985
	5) 365800	CCT 1-V-2011	101,31	0,15	-220			
	6) 374636	CCT 1-XI-2011	101,25	0,15	-318			
	7) 399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	-440			
	436105	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	2.510			
	385885	CCT 1-III-2012	101,16	0,15	750			
	436105	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	2.750			
432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	511				
Giugno	436105	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	2.750	3.850	401	3.449
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.100			
Luglio	436105	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	2.750	3.850	401	3.449
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.100			
Agosto	436105	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	2.000	4.500	—	4.500
	440496 #	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	2.500			
Settembre	441390 #	CTZ 31-XII-2009	91,92	—	4.375	5.625	9.832	-4.207
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	1.250			
Ottobre	441390	CTZ 31-XII-2009	91,92	—	2.200	3.059	—	3.059
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	859			
Novembre	441390	CTZ 31-XII-2009	91,92	—	2.200	2.200	—	2.200

1) Riacquistato al prezzo di 100,115 con l'asta di concambio del 7-III-2008. - 2) Riacquistato al prezzo di 100,10 con l'asta di concambio del 7-III-2008. - 3) Riacquistato al prezzo di 100,03 con l'asta di concambio del 7-III-2008. - 4) Riacquistato al prezzo di 100,15 con l'asta di concambio del 9-V-2008. - 5) Riacquistato al prezzo di 100,13 con l'asta di concambio del 9-V-2008. - 6) Riacquistato al prezzo di 100,09 con l'asta di concambio del 9-V-2008. - 7) Riacquistato al prezzo di 100,02 con l'asta di concambio del 9-V-2008.

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2005 AL 30 GIUGNO 2015
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2005 AND 30th JUNE 2015

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Dicembre	1) 321971	CCT 1-VII-2009	100,78	0,15	-323	3.652	17.449	-13.797
	2) 399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	-773			
	3) 338490	CCT 1-X-2009	101,13	0,15	-445			
	4) 410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	-770			
	5) 422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	-826			
	441390	CTZ 31-XII-2009	91,92	—	2.712			
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	940			
Totali						48.947	55.176	-6.229
2009								
Gennaio	441390	CTZ 30-IX-2010	91,92	—	2.200	3.198	—	3.198
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	998			
Febbraio	441390	CTZ 30-IX-2010	91,92	—	2.750	4.321	—	4.321
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	630			
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	941			
Marzo	448085 #	CTZ 31-III-2011	95,96	—	5.000	7.565	—	7.565
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.018			
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	1.547			
Aprile	448085	CTZ 31-III-2011	95,96	—	3.300	6.927	11.431	-4.504
	410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	945			
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.081			
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	1.601			
Maggio	448085	CTZ 31-III-2011	95,96	—	3.300	5.280	—	5.280
	385885	CCT 1-III-2012	101,16	0,15	840			
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	1.140			
Giugno	450921 #	CTZ 30-VI-2011	96,63	—	5.000	7.248	12.785	-5.537
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	972			
	440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	1.276			
Luglio	450921	CTZ 30-VI-2011	96,63	—	3.850	8.086	11.869	-3.783
	451871 #	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	4.236			

1) Riacquistato al prezzo di 100,03 con l'asta di concambio del 1-XII-2008. - 2) Riacquistato al prezzo di 95,85 con l'asta di concambio del 1-XII-2008. - 3) Riacquistato al prezzo di 100,29 con l'asta di concambio del 18-XII-2008. - 4) Riacquistato al prezzo di 94,16 con l'asta di concambio del 18-XII-2008. - 5) Riacquistato al prezzo di 93,61 con l'asta di concambio del 18-XII-2008.

CERTIFICATI DI CREDITO EMESSI E RIMBORSATI
TREASURY CREDIT CERTIFICATES ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Agosto.....	451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	2.750	2.750	10.300	-7.550
Settembre.....	453693 #	CTZ 30-IX-2011	97,25	—	5.000	7.475	—	7.475
	451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	2.475			
Ottobre.....	453693	CTZ 30-IX-2011	97,25	—	3.300	5.714	11.344	-5.630
	451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	2.414			
Novembre.....	453693	CTZ 30-IX-2011	97,25	—	2.750	2.750	—	2.750
Dicembre.....	453693	CTZ 30-IX-2011	97,25	—	2.501	4.669	11.700	-7.031
	451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	2.168			
Totali.....						65.983	69.429	-3.446
2010								
Gennaio.....	457291 #	CTZ 29-II-2012	96,82	—	4.000	5.756	—	5.756
	451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	1.756			
Febbraio.....	458420 #	CCT 1-III-2017	97,73	0,30	3.691	3.691	11.312	-7.621
Marzo.....	457291	CTZ 29-II-2012	96,82	—	6.600	8.250	—	8.250
	458420	CCT 1-III-2017	97,73	0,30	1.650			
Aprile.....	460509 #	CTZ 30-IV-2012	96,58	—	4.000	5.310	13.511	-8.201
	458420	CCT 1-III-2017	97,73	0,30	1.310			
Maggio.....	1) 374636	CCT 1-XI-2011	101,25	0,15	-90	3.925	90	3.835
	460509	CTZ 30-IV-2012	96,58	—	2.524			
	458420	CCT 1-III-2017	97,73	0,30	1.401			
Giugno.....	462030 #	CCT 15-XII-2015	99,88	—	4.000	7.999	13.195	-5.196
	2) 399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	-279			
	3) 410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	-269			
	4) 422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	-449			
	460509	CTZ 30-IV-2012	96,58	—	3.000			
	5) 462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	999			

1) Riacquistato al prezzo di 99,72 con l'asta di concambio del 20-V-2010. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747). - 2) Riacquistato al prezzo di 99,15 con l'asta di concambio del 24-VI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 3) Riacquistato al prezzo di 98,89 con l'asta di concambio del 24-VI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 4) Riacquistato al prezzo di 98,39 con l'asta di concambio del 24-VI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 5) Asta di concambio del 24-VI-2010.

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2005 AL 30 GIUGNO 2015
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2005 AND 30th JUNE 2015

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Luglio.....	460509	CTZ 30-IV-2012	96,58	—	2.750	4.484	914	3.570
	1) 385885	CCT 1-III-2012	101,16	0,15	-365			
	2) 399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	-72			
	3) 410144	CCT 1-VII-2013	100,76	0,15	-476			
	4) 462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	1.734			
Agosto.....	463412 #	CTZ 31-VIII-2012	96,64	—	4.001	9.214	—	9.214
	462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	5.213			
Settembre.....	462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	2.197	2.197	16.437	-14.240
Ottobre.....	5) 432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	-122	10.600	600	10.000
	6) 440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	-405			
	7) 451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	-71			
	465217 #	CCT 15-X-2017	99,78	—	5.100			
	463412	CTZ 31-VIII-2012	96,64	—	5.500			
Novembre.....	8) 385885	CCT 1-III-2012	101,16	0,15	-575	5.341	1.012	4.329
	9) 399315	CCT 1-XI-2012	100,70	0,15	-436			
	10) 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.757			
	463412	CTZ 31-VIII-2012	96,64	—	2.000			
Dicembre.....	466235 #	CTZ 31-XII-2012	100,00	—	245			
	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.339			
	467436 #	CTZ 31-XII-2012	94,39	—	4.017	6.317	14.194	-7.877
	462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	896			
	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.404			
Totali.....					73.084	71.265	1.819	
2011								
Gennaio.....	467436	CTZ 31-XII-2012	94,39	—	2.500	4.048	—	4.048
	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.548			
Febbraio.....	11) 385885	CCT 1-III-2012	101,16	0,15	-566	4.000	566	3.434
	467436	CTZ 31-XII-2012	94,39	—	2.500			
	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.500			

1) Riacquistato al prezzo di 99,37 con l'asta di concambio del 29-VII-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 2) Riacquistato al prezzo di 98,93 con l'asta di concambio del 29-VII-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 3) Riacquistato al prezzo di 98,68 con l'asta di concambio del 29-VII-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 4) Asta di concambio del 29-VII-2010. - 5) Riacquistato al prezzo di 97,8 con l'asta di concambio del 20-X-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 6) Riacquistato al prezzo di 97,05 con l'asta di concambio del 20-X-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 7) Riacquistato al prezzo di 96,45 con l'asta di concambio del 20-X-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 8) Riacquistato al prezzo di 99,65 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 9) Riacquistato al prezzo di 99,3 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 10) Asta di concambio del 15-XI-2010. - 11) Riacquistato al prezzo di 99,9 con l'asta di concambio dell'8-II-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2007-2018 4,5% (codice IT0004273493).

CERTIFICATI DI CREDITO EMESSI E RIMBORSATI
TREASURY CREDIT CERTIFICATES ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Marzo	467436	CTZ 31-XII-2012	94,39	—	2.500	3.985	11.600	-7.615
	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.485			
Aprile.....	1) 422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	-486	8.366	1.138	7.228
	2) 451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	-651			
	471632 #	CTZ 30-IV-2013	94,16	—	3.991			
	471631 #	CCT 15-IV-2018	98,38	—	4.375			
Maggio	471632	CTZ 30-IV-2013	94,16	—	2.200	4.233	14.567	-10.334
	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	2.033			
Giugno	466235	CTZ 31-XII-2012	100,00	—	2	5.218	8.850	-3.632
	471632	CTZ 30-IV-2013	94,16	—	2.750			
	462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	1.091			
	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	1.375			
Luglio	471632	CTZ 30-IV-2013	94,16	—	1.500	3.270	—	3.270
	462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	840			
	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	930			
Agosto.....	471632	CTZ 30-IV-2013	94,16	—	2.000	3.063	—	3.063
	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	1.063			
Settembre.....	3) 385885	CCT 1-III-2012	101,16	0,15	-108	4.375	4) 14.137	-9.762
	5) 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	-177			
	476518 #	CTZ 30-IX-2013	91,54	—	4.375			
Ottobre	6) 440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	-517	3.200	748	2.452
	7) 451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	-230			
	476518	CTZ 30-IX-2013	91,54	—	2.200			
	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.000			
Novembre	476518	CTZ 30-IX-2013	91,54	—	2.200	2.200	15.479	-13.279
Dicembre	8) 432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	-200	2.728	338	2.390
	9) 440496	CCT 1-IX-2015	99,01	0,15	-137			
	476518	CTZ 30-IX-2013	91,54	—	1.825			
	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	903			
Totali.....					48.686	67.423	-18.737	

1) Riacquistato al prezzo di 98,68 con l'asta di concambio del 5-IV-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2018 4,5% (codice IT0004361041). - 2) Riacquistato al prezzo di 96,65 con l'asta di concambio del 5-IV-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2018 4,5% (codice IT0004361041). - 3) Riacquistato al prezzo di 99,84 con l'asta di concambio del 21-IX-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2019 4,5% (codice IT0004423957). - 4) Riacquistato al prezzo di 83,1 con l'asta di concambio del 21-IX-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2008-2019 4,5% (codice IT0004423957). - 5) Di cui Euro 301 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 6) Riacquistato al prezzo di 90,9 con l'asta di concambio del 19-X-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2016 3,75% (codice IT0004712748). - 7) Riacquistato al prezzo di 88,8 con l'asta di concambio del 19-X-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2016 3,75% (codice IT0004712748). - 8) Riacquistato al prezzo di 92,1 con l'asta di concambio del 7-XII-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747). - 9) Riacquistato al prezzo di 87,9 con l'asta di concambio del 7-XII-2011. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2017 5,25% (codice IT0003242747).

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2005 AL 30 GIUGNO 2015
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2005 AND 30th JUNE 2015

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
2012								
Gennaio.....	479304 #	CTZ 31-I-2014	92,87	—	5.625	5.625	—	5.625
Febbraio	479304	CTZ 31-I-2014	92,87	—	3.300	3.300	10.600	-7.300
Marzo	479304	CTZ 31-I-2014	92,87	—	2.816	5.071	12.282	-7.211
	480980 #	CCT 15-III-2017	98,05	—	2.255			
Aprile.....	479304	CTZ 31-I-2014	92,87	—	2.750	2.750	12.274	-9.524
Maggio	482025 #	CTZ 30-V-2014	92,40	—	3.500	3.500	—	3.500
Giugno	482025	CTZ 30-V-2014	92,40	—	2.991	2.991	—	2.991
Luglio	482025	CTZ 30-V-2014	92,40	—	2.875	2.875	—	2.875
	482025	CTZ 30-V-2014	92,40	—	2.875			
Agosto.....	482025	CTZ 30-V-2014	92,40	—	3.450	4.392	11.501	-7.109
	480980	CCT 15-III-2017	98,05	—	942			
Settembre.....	485380 #	CTZ 30-IX-2014	95,11	—	3.936	5.086	—	5.086
	480380	CCT 15-III-2017	98,05	—	1.150			
Ottobre	485380	CTZ 30-IX-2014	95,11	—	3.000	3.000	—	3.000
	485380	CTZ 30-IX-2014	95,11	—	3.000			
Novembre	462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	1.025	5.050	1) 2) 13.925	-8.875
	485380	CTZ 30-IX-2014	95,11	—	4.025			
Dicembre	487439 #	CCT 1-XII-2016	100,00	—	14	3.344	3) 4) 11.965	-8.621
	485380	CTZ 30-IX-2014	95,11	—	3.330			
Totali.....					46.984	72.547	25.563	

1) Di cui euro 200 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 2) Di cui euro 250 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 3) Di cui euro 125 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 4) Di cui euro 75 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato.

CERTIFICATI DI CREDITO EMESSI E RIMBORSATI
TREASURY CREDIT CERTIFICATES ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
2013								
Gennaio.....	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	687	5.570	—	5.570
	480980	CCT 15-III-2017	98,05	—	813			
	489089 #	CTZ 31-XII-2014	97,31	—	4.070			
Febbraio.....	480980	CCT 15-III-2017	98,05	—	1.655	4.473	—	4.473
	489089	CTZ 31-XII-2014	97,31	—	2.818			
Marzo.....	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	737	5.075	¹⁾²⁾³⁾ 1.005	4.070
	480980	CCT 15-III-2017	98,05	—	1.182			
	489089	CTZ 31-XII-2014	97,31	—	3.156			
Aprile.....	480980	CCT 15-III-2017	98,05	—	1.533	4.033	12.441	-8.408
	489089	CTZ 31-XII-2014	97,31	—	2.500			
Maggio.....	492290 #	CCT 1-XI-2018	98,40	—	3.308	5.808	—	5.808
	489089	CTZ 31-XII-2014	97,31	—	2.500			
Giugno.....	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	1.397	7.900	—	7.900
	492290	CCT 1-XI-2018	98,4	—	1.953			
	493818 #	CTZ 30-VI-2015	95,35	—	4.550			
Luglio.....	492290	CCT 1-XI-2018	98,40	—	1.504	4.690	14.259	-9.569
	493818	CTZ 30-VI-2015	95,35	—	3.186			
Agosto.....	493818	CTZ 30-VI-2015	95,35	—	3.116	3.116	—	3.116
Settembre.....	471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	848	4.681	10.600	-5.919
	492290	CCT 1-XI-2018	98,4	—	1.333			
	493818	CTZ 30-VI-2015	95,35	—	2.500			
Ottobre.....	492290	CCT 1-XI-2018	98,40	—	1.437	4.024	—	4.024
	493818	CTZ 30-VI-2015	95,35	—	2.587			

1) Di cui euro 146 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 2) Di cui euro 188 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 3) Di cui euro 671 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato.

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2005 AL 30 GIUGNO 2015
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2005 AND 30th JUNE 2015

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Novembre.....	492290	CCT 1-XI-2018	98,4	—	1.150	4.990	1.073	3.917
	¹⁾ 462030	CCT 15-XII-2015	99,88	—	-908			
	²⁾ 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	-164			
	497820 #	CTZ 31-XII-2015	97,61	—	3.840			
Dicembre.....	497820	31-XII-2015	97,61	—	3.080	3.080	³⁾⁴⁾ 1.079	2.001
Totali.....					57.440	40.457		16.983
2014								
Gennaio.....	497820	31-XII-2015	97,61	—	2.875	4.559	14.491	-9.932
	492290	1-XI-2018	98,40	—	1.684			
Febbraio.....	⁵⁾ 462030	15-XII-2015	99,88	—	-510	5.174	1.037	4.137
	⁶⁾ 480980	15-III-2017	98,05	—	-527			
	497820	31-XII-2015	97,61	—	2.875			
	471631	15-IV-2018	98,38	—	1.187			
	492290	1-XI-2018	98,40	—	1.112			
Marzo.....	500983 #	15-XI-2019	101,14	—	3.250	3.250	13.434	-10.184
Aprile.....	502077 #	29-IV-2016	98,44	—	3.500	6.155	—	6.155
	500983	15-XI-2019	101,14	—	2.655			
Maggio.....	⁷⁾ 440496	1-IX-2015	99,01	0,15	-434	5.325	13.685	-8.360
	⁸⁾ 465217	15-X-2017	99,78	—	-435			
	502077	29-IV-2016	98,44	—	3.450			
	500983	15-XI-2019	101,14	—	1.875			
Giugno.....	⁹⁾ 462030	15-XII-2015	99,88	—	-592	4.548	592	3.956
	502077	29-IV-2016	98,44	—	2.875			
	500983	15-XI-2019	101,14	—	1.673			
Luglio.....	500983	15-XI-2019	101,14	—	1.500	1.500	—	1.500
Agosto.....	504497 #	30-VIII-2016	99,35	—	3.073	4.798	—	4.798
	500983	15-XI-2019	101,14	—	1.725			
Settembre.....	504497	30-VIII-2016	99,35	—	2.902	6.708	14.292	-7.584
	505654 #	15-XII-2020	100,34	—	3.806			

1) Riacquistato al prezzo di 99,73 con l'asta di concambio del 18-XI-2013. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 2) Riacquistato al prezzo di 96,84 con l'asta di concambio del 18-XI-2013. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 3) Di cui Euro 604 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 4) Di cui Euro 475 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 5) Riacquistato al prezzo di 100,515 con l'asta di concambio del 17-II-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004907843). - 6) Riacquistato al prezzo di 104,16 con l'asta di concambio del 17-II-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004907843). - 7) Riacquistato al prezzo di 99,885 con l'asta di concambio del 21-V-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 8) Riacquistato al prezzo di 99,43 con l'asta di concambio del 21-V-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2018 3,5% (codice IT0004957574). - 9) Riacquistato al prezzo di 100,76 con l'asta di concambio del 20-VI-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2022 5% (codice IT0004759673).

CERTIFICATI DI CREDITO EMESSI E RIMBORSATI
TREASURY CREDIT CERTIFICATES ISSUED AND

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Ottobre	1) 462030	15-XII-2015	99,88	—	-299	5.130	499	4.631
	2) 465217	15-X-2017	99,78	—	-199			
	504497	30-VIII-2016	99,35	—	2.875			
	505654	15-XII-2020	100,34	—	2.255			
Novembre	505654	15-XII-2020	100,34	—	1.725	1.725	—	1.725
Dicembre	504497	30-VIII-2016	99,35	—	2.875	4.431	3)4) 28.630	-24.199
	505654	15-XII-2020	100,34	—	1.556			
Totali.....					53.303	86.660		-33.357
2015								
Gennaio.....	504497	CTZ 30-VIII-2016	99,35	—	2.101	4.113	—	4.113
	505654	CCT 15-XII-2020	100,34	—	2.012			
Febbraio	508995 #	CTZ 27-II-2017	99,56	—	3.811	5.823	—	5.823
	505654	CCT 15-XII-2020	100,34	—	2.012			
Marzo	508995	CTZ 27-II-2017	99,56	—	2.300	6.200	—	6.200
	510447 #	CCT 15-VI-2022	100,13	—	3.900			
Aprile.....	5) 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	-419	4.887	419	4.468
	508995	CTZ 27-II-2017	99,56	—	2.300			
	510447	CCT 15-VI-2022	100,13	—	2.587			
Maggio	508995	CTZ 27-II-2017	99,56	—	2.277	4.577	—	4.577
	510447	CCT 15-VI-2022	100,13	—	2.300			
Giugno	508995	CTZ 27-II-2017	99,56	—	2.012	4.790	15.941	-11.151
	510447	CCT 15-VI-2022	100,13	—	2.778			
Luglio	6) 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	-318	2.012	747	1.265
	7) 471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	-429			
	510447	CCT 15-VI-2022	100,13	—	2.012			
Agosto.....	512698 #	CTZ 30-VIII-2017	99,66	—	3.671	5.396	—	5.396
	510447	CCT 15-VI-2022	100,13	—	1.725			

1) Riacquistato al prezzo di 100,6 con l'asta di concambio del 16-X-2014. Titolo offerto in asta: BTP 1993-2023 9% (codice IT0000366655). - 2) Riacquistato al prezzo di 100,58 con l'asta di concambio del 16-X-2014. Titolo offerto in asta: BTP 1993-2023 9% (codice IT0000366655). - 3) Di cui Euro 715 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 4) Di cui Euro 523 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 5) Riacquistato al prezzo di 101,56 con l'asta di concambio del 17-IV-2015. Titolo offerto in asta: BTP 2009-2025 5% (codice IT0004513641). - 6) Riacquistato al prezzo di 101,47 con l'asta di concambio del 17-VII-2015. Titolo offerto in asta BTP 2014-2030 3,3% (codice IT0005024234). - 7) Riacquistato al prezzo di 101,97 con l'asta di concambio del 17-VII-2015. Titolo offerto in asta BTP 2014-2020 (codice IT0005024234).

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2005 AL 30 GIUGNO 2015
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2005 AND 30th JUNE 2015

Mese di emissione	Codice ISIN	Titolo	Prezzo %	Spread	Importo emesso (milioni di euro)	Totale emesso (milioni di euro) (a)	Importo rimborsato (milioni di euro) (b)	Saldo mensile (a) - (b)
Settembre.....	1) 451871	CCT 1-VII-2016	97,65	0,15	-518	6.200	11.440	-5.240
	2) 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	-518			
	3) 471631	CCT 15-IV-2018	98,38	—	-379			
	512698	CTZ 30-VIII-2017	99,66	—	2.300			
	513761 #	CCT 15-XII-2022	99,93	—	3.900			
Ottobre	512698	CTZ 30-VIII-2017	99,66	—	2.012	3.728	—	3.728
	513761	CCT 15-XII-2022	99,93	—	1.716			
Novembre	512698	CTZ 30-VIII-2017	99,66	—	1.725	2.725	—	2.725
	513761	CCT 15-XII-2022	99,93	—	1.000			
Dicembre	512698	CTZ 30-VIII-2017	99,66	—	1.636	3.273	27.688	-24.415
	513761	CCT 15-XII-2022	99,93	—	1.637			
Totali.....					53.724	56.236		-2.512
2016								
Gennaio.....	512698	CTZ 30-VIII-2017	99,66	—	1.501	3.513	—	3.513
	513761	CCT 15-XII-2022	99,93	—	2.012			
Febbraio	513761	CCT 15-XII-2022	99,93	—	2.300	2.300	—	2.300
Marzo	4) 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	-429	3.427	429	2.998
	517536 #	CTZ 28-III-2018	100,12	—	3.427			
Aprile.....	513761	CCT 15-XII-2022	99,93	—	1.725	5.495	9.825	-4.330
	518545 #	CCT 15-VII-2023	100,38	—	3.770			
Maggio	5) 492290	CCT 1-XI-2018	98,4	—	-799	4.800	799	4.001
	517536	CTZ 28-III-2018	100,12	—	2.500			
	518545	CCT 15-VII-2023	100,38	—	2.300			
Giugno	6) 480980	CCT 15-III-2017	98,05	—	-138	2.012	797	1.215
	7) 508995	CTZ 27-II-2017	99,56	—	-658			
	518545	CCT 15-VII-2023	100,38	—	2.012			
Totali.....					21.547	11.851		9.696

1) Riacquistato al prezzo di 100,245 con l'asta di concambio del 16-IX-2015. Titolo offerto in asta CCT 2014-2020 (codice IT0005056541). - 2) Riacquistato al prezzo di 100,245 con l'asta di concambio del 16-IX-2015. Titolo offerto in asta CCTeu 2014-2020 (codice IT0005056541). - 3) Riacquistato al prezzo di 102,1 con l'asta di concambio del 16-IX-2015. Titolo offerto in asta CCTeu 2014-2020 (codice IT0005056541). - 4) Riacquistato al prezzo di 101,065 con l'asta di concambio del 4-III-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 5) Riacquistato al prezzo di 104,02 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 6) Riacquistato al prezzo di 102,32 con l'asta di concambio del 17-VI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2023 4,50% (codice IT0004898034). - 7) Riacquistato al prezzo di 100,045 con l'asta di concambio del 17-VI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2013-2023 4,50% (codice IT0004898034).

BUONI DEL TESORO POLIENNALI E CERTIFICATI DI CREDITO EMESSI E
MEDIUM-DATED TREASURY BILLS AND TREASURY CREDIT CERTIFICATES

EMISSIONI (milioni di euro)				RIMBORSI (milioni di euro)		
	B.T.P.	Certificati di Credito emessi dal Tesoro	Totale	B.T.P.	Certificati di Credito emessi dal Tesoro	Totale
2006						
1° semestre	86.659	25.417	112.076	46.547	27.092	73.639
2° semestre	41.250	20.350	61.600	32.768	27.727	60.496
	<u>127.909</u>	<u>45.767</u>	<u>173.676</u>	<u>79.315</u>	<u>54.819</u>	<u>134.135</u>
2007						
1° semestre	81.101	28.385	109.486	58.417	18.019	76.437
2° semestre	52.122	20.856	72.978	42.606	31.330	73.937
	<u>133.223</u>	<u>49.241</u>	<u>182.464</u>	<u>101.023</u>	<u>49.349</u>	<u>150.374</u>
2008						
1° semestre	84.357	26.061	110.418	69.913	27.494	97.407
2° semestre	73.197	22.886	96.083	28.893	27.683	56.576
	<u>157.554</u>	<u>48.947</u>	<u>206.501</u>	<u>98.806</u>	<u>55.177</u>	<u>153.983</u>
2009						
1° semestre	105.788	34.539	140.327	70.657	24.216	94.874
2° semestre	79.054	31.444	110.498	23.451	45.214	68.665
	<u>184.842</u>	<u>65.983</u>	<u>250.825</u>	<u>94.108</u>	<u>69.430</u>	<u>163.539</u>
2010						
1° semestre	106.793	34.931	141.724	49.647	38.109	87.756
2° semestre	88.815	38.153	126.968	54.580	33.157	87.738
	<u>195.608</u>	<u>73.084</u>	<u>268.692</u>	<u>104.227</u>	<u>71.266</u>	<u>175.494</u>
2011						
1° semestre	92.089	29.850	121.939	38.443	36.722	75.066
2° semestre	72.288	18.836	91.124	56.171	30.704	86.875
	<u>164.377</u>	<u>48.686</u>	<u>213.063</u>	<u>94.514</u>	<u>67.426</u>	<u>161.941</u>

RIMBORSATI DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2006 AL 30 GIUGNO 2016 - RIEPILOGO
ISSUED AND REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2006 AND 30th JUNE 2016 - OVERALL TOTAL

EMISSIONI (milioni di euro)				RIMBORSI (milioni di euro)		
	B.T.P.	Certificati di Credito emessi dal Tesoro	Totale	B.T.P.	Certificati di Credito emessi dal Tesoro	Totale
2012						
1° semestre	89.426	23.237	112.663	55.743	35.156	90.899
2° semestre	90.584	23.747	114.331	65.562	37.392	102.955
	<u>180.010</u>	<u>46.984</u>	<u>226.994</u>	<u>121.305</u>	<u>72.548</u>	<u>193.854</u>
2013						
1° semestre	114.001	32.859	146.860	56.720	13.447	70.167
2° semestre	94.905	24.581	119.486	67.739	27.012	94.751
	<u>208.906</u>	<u>57.440</u>	<u>266.346</u>	<u>124.459</u>	<u>40.459</u>	<u>164.918</u>
2014						
1° semestre	122.133	29.011	151.144	38.560	43.241	81.801
2° semestre	78.519	24.292	102.811	73.932	43.421	117.353
	<u>200.652</u>	<u>53.303</u>	<u>253.955</u>	<u>112.492</u>	<u>86.662</u>	<u>199.154</u>
2015						
1° semestre	118.910	30.390	149.300	69.215	16.360	85.575
2° semestre	70.514	23.334	93.848	73.504	39.876	113.380
	<u>189.424</u>	<u>53.724</u>	<u>243.148</u>	<u>142.719</u>	<u>56.236</u>	<u>198.955</u>
2016						
1° semestre	117.821	21.547	139.368	43.967	11.851	55.818

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
	DI STATO												
IT0005186397	BOT 12-V-2017	—	2016	—	12-V-2017	—	12-V	6.500.000	10.417	6.500.000	1000	100,14	—
IT0005125627	BOT 12-VIII-2016	—	2015	—	12-VIII-2016	—	12-VIII	6.000.000	80.993	6.000.000	1000	99,99	—
IT0005160111	BOT 13-I-2017	—	2016	—	13-I-2017	—	13-I	7.000.000	31.180	7.000.000	1000	100,08	—
IT0005176190	BOT 13-IV-2017	—	2016	—	13-IV-2017	—	13-IV	6.075.000	10.840	6.075.000	1000	100,08	—
IT0005162620	BOT 14-II-2017	—	2016	—	14-II-2017	—	14-II	6.500.000	74.258	6.500.000	1000	100,03	—
IT0005171720	BOT 14-III-2017	—	2016	—	14-III-2017	—	14-III	6.600.000	12.198	6.600.000	1000	100,07	—
IT0005127375	BOT 14-IX-2016	—	2015	—	14-IX-2016	—	14-IX	7.500.000	106.449	7.500.000	1000	99,97	—
IT0005199341	BOT 14-VI-2017	—	2016	—	14-VI-2017	—	14-VI	6.500.000	4.747	6.500.000	1000	100,12	—
IT0005122061	BOT 14-VII-2016	—	2015	—	15-VII-2016	—	15-VII	7.067.439	154.190	7.067.439	1000	99,87	—
IT0005138208	BOT 14-X-2016	—	2015	—	14-X-2016	—	14-X	7.100.000	61.447	7.100.000	1000	99,98	—
IT0005142739	BOT 14-XI-2016	—	2015	—	14-XI-2016	—	14-XI	6.600.000	52.968	6.600.000	1000	100,03	—
IT0005154775	BOT 14-XII-2016	—	2015	—	14-XII-2016	—	14-XII	5.500.000	80.393	5.500.000	1000	100,00	—
IT0005160129	BOT 29-VII-2016	—	2016	—	29-VII-2016	—	29-VII	6.500.000	33.711	6.500.000	1000	100,04	—
IT0005171738	BOT 30-IX-2016	—	2016	—	30-IX-2016	—	30-IX	6.600.000	31.566	6.600.000	1000	100,03	—
IT0005186405	BOT 30-XI-2016	—	2016	—	30-XI-2016	—	30-XI	6.000.000	1.439	6.000.000	1000	100,13	—
IT0005199358	BOT 30-XII-2016	—	2016	—	30-XII-2016	—	30-XII	6.406.080	755	6.406.080	1000	100,08	—
IT0005162638	BOT 31-VIII-2016	—	2016	—	31-VIII-2016	—	31-VIII	6.875.000	8.958	6.875.000	1000	100,02	—
IT0005176182	BOT 31-X-2016	—	2016	—	31-X-2016	—	31-X	6.600.000	6.842	6.600.000	1000	100,09	—
IT0000366655	BTP 1993-2023 9%	9,00	1993	—	01-XI-2023	01-V	01-XI	11.226.155	447.821	11.226.155	0,01	93,75	—
IT0001086567	BTP 1996-2026 7,25%	7,25	1996	—	01-XI-2026	01-V	01-XI	9.417.828	193.272	9.417.828	0,01	99,45	—
IT0001174611	BTP 1997-2027 6,5%	6,50	1997	—	01-XI-2027	01-V	01-XI	26.013.130	323.983	26.013.132	0,01	100,15	—
IT0001278511	BTP 1998-2029 5,25%	5,25	1998	—	01-XI-2029	01-V	01-XI	28.148.499	1.102.752	29.762.750	0,01	99,70	—
IT0001444378	BTP 2000-2031 6%	6,00	1999	—	01-V-2031	01-V	01-V	29.762.750	265.974	29.762.750	1000	102,40	—
IT0003242747	BTP 2002-2017 5,25%	5,25	2002	—	01-VIII-2017	01-II	01-VIII	22.249.234	354.617	24.300.000	1000	98,35	—
IT0003256820	BTP 2002-2033 5,75%	5,75	2002	—	01-II-2033	01-II	01-II	15.454.000	253.125	15.454.000	1000	101,15	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0003493258	BTP 2003-2019 4,25%	4,25	2003	—	01-II-2019	01-II	01-II	24.629.574	600.801	24.629.574	1000	99,16	—
IT0003535157	BTP 2003-2034 5%	5,00	2003	—	01-VIII-2034	01-II	01-VIII	21.832.921	1.041.406	21.832.921	1000	98,11	—
IT0003644769	BTP 2004-2020 4,5%	4,50	2004	—	01-II-2020	01-II	01-II	22.659.650	425.813	22.659.650	1000	99,67	—
IT0003934657	BTP 2005-2037 4%	4,00	2005	—	01-II-2037	01-II	01-II	26.291.398	8.984.379	26.291.398	1000	101,29	—
IT0004019581	BTP 2006-2016 3,75%	3,75	2006	—	01-VIII-2016	01-II	01-VIII	25.929.538	253.542	26.738.234	1000	100,36	—
IT0004009673	BTP 2006-2021 3,75%	3,75	2006	—	01-VIII-2021	01-II	01-VIII	26.628.325	1.211.146	26.628.325	1000	98,26	—
IT0004164775	BTP 2007-2017 4%	4,00	2007	—	01-II-2017	01-II	01-II	24.397.060	248.434	25.598.455	1000	98,95	—
IT0004273493	BTP 2007-2018 4,5%	4,50	2007	—	01-II-2018	01-II	01-II	23.710.375	283.958	24.806.256	1000	99,98	—
IT0004286966	BTP 2007-2039 5%	5,00	2007	—	01-VIII-2039	01-II	01-VIII	19.336.563	725.166	19.336.563	1000	99,98	—
IT0004361041	BTP 2008-2018 4,5%	4,50	2008	—	01-VIII-2018	01-II	01-VIII	25.499.297	417.000	25.499.297	1000	99,19	—
IT0004423957	BTP 2008-2019 4,5%	4,50	2008	—	01-III-2019	01-III	01-III	22.644.728	435.008	22.644.728	1000	94,35	—
IT0004356843	BTP 2008-2023 4,75%	4,75	2008	—	01-VIII-2023	01-II	01-VIII	24.799.152	784.840	24.799.152	1000	99,14	—
IT0004489610	BTP 2009-2019 4,25%	4,25	2009	—	01-IX-2019	01-III	01-IX	25.012.075	692.249	25.012.075	1000	99,20	—
IT0004536949	BTP 2009-2020 4,25%	4,25	2009	—	01-III-2020	01-III	01-III	24.330.808	1.384.740	24.330.808	1000	101,92	—
IT0004513641	BTP 2009-2025 5%	5,00	2009	—	01-III-2025	01-III	01-III	23.868.669	1.448.596	23.868.669	1000	99,01	—
IT0004532559	BTP 2009-2040 5%	5,00	2009	—	01-IX-2040	01-III	01-IX	21.547.605	1.805.929	21.547.605	1000	98,19	—
IT0004594930	BTP 2010-2020 4%	4,00	2010	—	01-IX-2020	01-III	01-IX	24.922.124	1.133.254	24.922.124	1000	100,70	—
IT0004634132	BTP 2010-2021 3,75%	3,75	2010	—	01-III-2021	01-III	01-III	24.268.782	877.400	24.268.782	1000	99,83	—
IT0004644735	BTP 2010-2026 4,5%	4,50	2010	—	01-IX-2026	01-III	01-IX	20.733.398	1.214.443	20.733.398	1000	100,07	—
IT0004761950	BTP 2011-2016 4,75%	4,75	2011	—	15-IX-2016	15-III	15-IX	15.987.979	114.343	15.987.979	1000	96,65	—
IT0004695075	BTP 2011-2021 4,75%	4,75	2011	—	01-III-2021	01-III	01-III	24.986.368	718.275	24.986.368	1000	99,73	—
IT0004759673	BTP 2011-2022 5%	5,00	2011	—	01-III-2022	01-III	01-III	20.635.579	571.912	20.635.579	1000	98,75	—
IT0004867070	BTP 2012-2017 3,5%	3,50	2012	—	01-XI-2017	01-V	01-XI	16.508.550	226.975	17.341.203	1000	98,80	—
IT0004793474	BTP 2012-2017 4,75%	4,75	2012	—	01-V-2017	01-V	01-V	13.107.937	195.159	13.646.480	1000	97,40	—
IT0004820426	BTP 2012-2017 4,75%	4,75	2012	—	01-VI-2017	01-VI	01-VI	15.587.055	194.686	15.809.424	1000	96,40	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0004801541	BTP 2012-2022 5,5%	5,50	2012	—	01-III-2022	01-III	01-III	19.586.032	534.190	19.586.032	1000	100,58	—
IT0004848831	BTP 2012-2022 5,5%	5,50	2012	—	01-XI-2022	01-V	01-XI	21.378.388	478.289	21.378.388	1000	98,20	—
IT0004960826	BTP 2013-2016 2,75%	2,75	2013	—	15-XI-2016	15-V	15-XI	12.402.040	102.792	12.402.040	1000	100,16	—
IT0004907843	BTP 2013-2018 3,5%	3,50	2013	—	01-VI-2018	01-VI	01-VI	19.388.580	279.434	19.950.805	1000	99,44	—
IT0004957574	BTP 2013-2018 3,5%	3,50	2013	—	01-XII-2018	01-VI	01-XII	19.858.640	427.815	19.858.640	1000	100,71	—
IT0004966401	BTP 2013-2021 3,75%	3,75	2013	—	01-V-2021	01-V	01-V	18.397.553	972.796	18.397.553	1000	100,14	—
IT0004898034	BTP 2013-2023 4,5%	4,50	2013	—	01-V-2023	01-V	01-V	20.070.594	773.582	20.070.594	1000	97,81	—
IT0004953417	BTP 2013-2024 4,5%	4,50	2013	—	01-VIII-2024	01-II	01-VIII	23.264.571	1.164.209	23.264.571	1000	100,77	—
IT0004889033	BTP 2013-2028 4,75%	4,75	2013	—	01-IX-2028	01-III	01-IX	19.783.654	865.625	19.783.654	1000	100,02	—
IT0004923998	BTP 2013-2044 4,75%	4,75	2013	—	01-IX-2044	01-III	01-IX	15.620.263	1.948.825	15.620.263	1000	97,22	—
IT0004987191	BTP 2014-2016 1,5%	1,50	2014	—	15-XII-2016	15-VI	15-XII	15.564.494	166.271	16.004.788	1000	100,00	—
IT0005023459	BTP 2014-2017 1,15%	1,15	2014	—	15-V-2017	15-V	15-V	13.284.230	203.853	15.132.488	1000	100,25	—
IT0005058463	BTP 2014-2018 0,75%	0,75	2014	—	15-I-2018	15-I	15-I	15.733.746	263.591	15.733.746	1000	100,17	—
IT0005069395	BTP 2014-2019 1,05%	1,05	2014	—	01-XII-2019	01-VI	01-XII	15.470.969	1.625.830	15.470.969	1000	100,53	—
IT0005030504	BTP 2014-2019 1,5%	1,50	2014	—	01-VIII-2019	01-II	01-VIII	16.393.156	698.404	16.393.156	1000	100,74	—
IT0004992308	BTP 2014-2019 2,5%	2,50	2014	—	01-V-2019	01-V	01-V	18.316.158	463.989	18.316.158	1000	100,40	—
IT0005028003	BTP 2014-2021 2,15%	2,15	2014	—	15-XII-2021	15-VI	15-XII	17.657.877	1.927.297	17.657.877	1000	100,27	—
IT0005045270	BTP 2014-2024 2,5%	2,50	2014	—	01-XII-2024	01-VI	01-XII	20.383.767	2.111.539	20.383.767	1000	101,14	—
IT0005001547	BTP 2014-2024 3,75%	3,75	2014	—	01-IX-2024	01-III	01-IX	19.826.000	1.113.488	19.826.000	1000	103,11	—
IT0005024234	BTP 2014-2030 3,5%	3,50	2014	—	01-III-2030	01-III	01-III	21.956.449	2.153.039	21.956.449	1000	99,47	—
IT0005083057	BTP 2014-2046 3,25%	3,25	2014	—	01-IX-2046	01-III	01-IX	13.240.724	19.537.544	13.240.724	1000	99,71	—
IT0005106049	BTP 2015-2018 0,25%	0,25	2015	—	15-V-2018	15-V	15-V	14.247.338	769.545	14.247.338	1000	100,07	—
IT0005139099	BTP 2015-2018 0,3%	0,30	2015	—	15-X-2018	15-IV	15-X	12.199.233	501.199	12.199.233	1000	100,15	—
IT0005142143	BTP 2015-2020 0,65%	0,65	2015	—	01-XI-2020	01-V	01-XI	14.068.700	2.304.663	14.068.700	1000	100,57	—
IT0005107708	BTP 2015-2020 0,7%	0,70	2015	—	01-V-2020	01-V	01-V	15.308.150	2.688.278	15.308.150	1000	100,33	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0005086886	BTP 2015-2022 1,35%	1,35	2015	—	15-IV-2022	15-IV	15-IV	17.784.500	2.688.278	17.784.500	1000	100,80	—
IT0005135840	BTP 2015-2022 1,45%	1,45	2015	—	15-IX-2022	15-III	15-IX	17.005.194	1.777.820	17.005.194	1000	100,54	—
IT0005090318	BTP 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	01-VI-2025	01-VI	01-VI	19.786.723	8.855.745	19.786.723	1000	101,40	—
IT0005127086	BTP 2015-2025 2%	2,00	2015	—	01-XII-2025	01-VI	01-XII	17.829.296	2.990.335	17.829.296	1000	100,51	—
IT0005094088	BTP 2015-2032 1,65%	1,65	2015	—	01-III-2032	01-III	01-III	17.640.833	15.603.329	17.640.833	1000	99,50	—
IT0005177271	BTP 2016-2019 0,10%	0,10	2016	—	15-IV-2019	15-IV	15-IV	8.048.021	140.325	8.048.021	1000	100,15	—
IT0005175598	BTP 2016-2021 0,45%	0,45	2016	—	01-VI-2021	01-VI	01-VI	11.883.296	897.172	11.883.296	1000	100,55	—
IT0005172322	BTP 2016-2023 0,95%	0,95	2016	—	15-III-2023	15-III	15-III	13.743.843	991.080	13.743.843	1000	101,07	—
IT0005170839	BTP 2016-2026 1,6%	1,60	2016	—	01-VI-2026	01-VI	01-VI	16.624.500	1.973.805	16.624.500	1000	100,97	—
IT0005177909	BTP 2016-2036 2,25%	2,25	2016	—	01-IX-2036	01-III	01-IX	6.500.000	1.679.266	6.500.000	1000	99,37	—
IT0005162828	BTP 2016-2047 2,7%	2,70	2016	—	01-III-2047	01-III	01-III	11.632.846	7.841.550	11.632.846	1000	99,18	—
IT0004863608	BTP Italia 2012-2016 2,55%	1,28	2012	—	22-X-2016	22-IV	22-X	18.017.975	5.041.341	18.017.975	1000	100,00	—
IT0004969207	BTP Italia 2013-2017 2,15%	1,08	2013	—	12-XI-2017	12-V	12-XI	22.271.853	6.067.506	22.271.853	1000	100,00	—
IT0004917958	BTP Italia 2013-2017 2,25%	1,13	2013	—	22-IV-2017	22-IV	22-IV	17.056.409	4.603.234	17.056.409	1000	100,00	—
IT0005012783	BTP Italia 2014-2020 1,65%	0,83	2014	—	23-IV-2020	23-IV	23-IV	20.565	6.233.136	20.565	1000	100,00	—
IT0005105843	BTP Italia 2015-2023 0,5%	0,25	2015	—	20-IV-2023	20-IV	20-IV	9.379.071	5.402.752	9.379.071	1000	100,00	Eventuale premio a scadenza pari al 4 per mille sul capitale nominale investito non rivalutato in caso di detenzione del titolo a partire dai giorni di emissione fino a scadenza.
IT0005188120	BTP Italia 2016-2022 0,10%	0,10	2016	—	15-V-2022	15-V	15-V	3.000.000	150.415	3.000.000	1000	99,82	Eventuale premio a scadenza pari al 4 per mille sul capitale nominale investito non rivalutato in caso di detenzione del titolo a partire dai giorni di emissione fino a scadenza.
IT0005174906	BTP Italia 2016-2024 0,4%	0,20	2016	—	11-IV-2024	11-IV	11-IV	8.014.368	1.433.824	8.014.368	1000	100,00	Eventuale premio a scadenza pari al 4 per mille sul capitale nominale investito non rivalutato in caso di detenzione del titolo a partire dai giorni di emissione fino a scadenza.
IT0003745541	BTPei 2004-2035 2,35%	1,18	2004	—	15-IX-2035	15-III	15-IX	13.077.270	310.552	13.684.800	1000	99,68	—
IT0004085210	BTPei 2006-2017 2,1%	1,05	2006	—	15-IX-2017	15-III	15-IX	13.591.521	79.032	14.551.332	1000	99,53	—
IT0004243512	BTPei 2007-2023 2,6%	1,30	2007	—	15-IX-2023	15-III	15-IX	17.650.347	270.836	17.650.347	1000	99,09	—
IT0004380546	BTPei 2008-2019 2,35%	1,18	2008	—	15-IX-2019	15-III	15-IX	17.320.527	275.386	17.320.527	1000	99,79	—
IT0004545890	BTPei 2009-2041 2,55%	1,28	2009	—	15-IX-2041	15-III	15-IX	7.792.870	624.621	7.792.870	1000	98,89	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
				Primo rimborso	Ultimo rimborso									
IT0004604671	BTPei 2010-2021 2,1%	1,05	2010	—	15-IX-2021	15-III	15-IX	17.311.846	361.104	17.311.846	1000	99,33	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.	
IT0004682107	BTPei 2011-2016 2,1%	1,05	2011	—	15-IX-2016	15-III	15-IX	9.123.013	143.834	9.123.013	1000	99,50	—	
IT0004735152	BTPei 2011-2026 3,1%	1,55	2011	—	15-IX-2026	15-III	15-IX	10.740.726	430.743	10.740.726	1000	100,03	—	
IT0004890882	BTPei 2013-2018 1,7%	0,85	2013	—	15-IX-2018	15-III	15-IX	10.764.638	127.472	10.764.638	1000	99,50	—	
IT0005004426	BTPei 2014-2024 2,35%	1,18	2014	—	15-IX-2024	15-III	15-IX	12.569.701	589.130	12.569.701	1000	99,76	—	
IT0005138828	BTPei 2015-2032 1,25%	0,63	2015	—	15-IX-2032	15-III	15-IX	5.663.111	797.550	5.663.111	1000	99,77	Corresponsione di un premio all'atto del rimborso.	
IT0004584204	CCT 2010-2017	0,13	2010	—	01-III-2017	01-III	01-III	7.865.301	892.253	8.053.301	1000	97,73	—	
IT0004874399	CCT 2012-2016	1,50	2012	—	01-XII-2016	01-VI	01-XII	14.614	2.180	14.614	1000	100,00	—	
IT0004652175	CCTeu 2010-2017	0,34	2010	—	15-X-2017	15-IV	15-X	13.314.296	1.101.194	15.646.286	1000	99,79	—	
IT0004809809	CCTeu 2011-2017	1,19	2011	—	15-III-2017	15-III	15-III	8.867.293	259.194	9.533.513	1000	98,05	—	
IT0004716319	CCTeu 2011-2018	0,44	2011	—	15-IV-2018	15-IV	15-IV	13.717.165	967.858	14.526.409	1000	98,38	—	
IT0004922909	CCTeu 2013-2018	0,85	2013	—	01-XI-2018	01-V	01-XI	12.685.065	633.841	13.484.709	1000	98,40	—	
IT0005009839	CCTeu 2013-2019	0,54	2013	—	15-XI-2019	15-V	15-XI	12.679.855	542.431	12.679.855	1000	101,14	—	
IT0005056541	CCTeu 2014-2020	0,33	2014	—	15-XII-2020	15-VI	15-XII	13.368.775	1.373.382	13.368.775	1000	100,34	—	
IT0005104473	CCTeu 2014-2022	0,20	2014	—	15-VI-2022	15-VI	15-VI	15.303.945	4.291.122	15.303.945	1000	100,13	—	
IT0005137614	CCTeu 2015-2022	0,28	2015	—	15-XII-2022	15-VI	15-XII	14.291.902	2.652.185	14.291.902	1000	99,93	—	
IT0005185456	CCTeu 2016-2023	0,32	2016	—	15-VII-2023	15-I	15-VII	8.083.225	1.179.482	8.083.225	1000	100,38	—	
IT0005089955	CTZ 27-II-2017	—	2015	—	27-II-2017	—	27-II	12.043.273	727.452	12.701.926	1000	99,56	—	
IT0005175366	CTZ 28-III-2018	—	2016	—	28-III-2018	—	28-III	5.927.936	145.213	5.927.936	1000	100,13	—	
IT0005044976	CTZ 30-VIII-2016	—	2014	—	30-VIII-2016	—	30-VIII	13.827.548	614.322	13.827.548	1000	99,35	—	
IT0005126989	CTZ 30-VIII-2017	—	2015	—	30-VIII-2017	—	30-VIII	12.847.033	449.666	12.847.033	1000	99,67	—	
US465410AH18	Republic of Italy 1993-2023 6,875% USD	6,88	1993	—	27-IX-2023	27-III	27-IX	USD 3.500.000	USD 83.907	USD 3.500.000	USD	1.000	98,73	—
XS0100688190	Republic of Italy 1999-2019 Euro CMS	0,64	1999	—	30-VIII-2019	30-VIII	30-VIII	1.000.000	77.475	1.000.000	1000	100,75	—	
XS0098449456	Republic of Italy 1999-2029 CMS 30Y con Floor 4,25%	4,25	1999	—	28-VI-2029	28-VI	28-VI	905.000	68.320	1.000.000	1000	101,60	—	

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS0133144898	Republic of Italy 2001-2016 5,75%	5,75	2001	—	25-VII-2016	25-VII	25-VII	3.000.000	2.227	3.000.000	1000	100,04	—
US465410BG26	Republic of Italy 2003-2033 5,375% USD	5,38	2003	—	15-VI-2033	15-VI	15-VI	USD 2.000.000	USD 259.873	USD 2.000.000	USD 1.000	98,44	—
US465410BR80	Republic of Italy 2006-2016 5,25% USD	5,25	2007	—	20-IX-2016	20-III	20-IX	USD 3.000.000	USD 4.500	USD 3.000.000	USD 100.000	100,00	—
US465410BS63	Republic of Italy 2007-2017 5,375% USD	5,38	2007	—	12-VI-2017	12-VI	12-VI	USD 2.000.000	USD 8.400	USD 2.000.000	USD 100.000	99,37	—
DE0001141612	BOBL 2011-2016 1,25%	1,25	2011	—	14-X-2016	14-X	14-X	6.000.000	3.689	6.000.000	0,01	100,15	—
DE0001141638	BOBL 2012-2017 0,5%	0,50	2012	—	07-IV-2017	07-IV	07-IV	5.000.000	1.756	5.000.000	0,01	99,70	—
DE0001141646	BOBL 2012-2017 0,5%	0,50	2012	—	13-X-2017	13-X	13-X	5.000.000	733	5.000.000	0,01	99,43	—
DE0001141620	BOBL 2012-2017 0,75%	0,75	2012	—	24-II-2017	24-II	24-II	4.000.000	15.859	4.000.000	0,01	99,24	—
DE0001141661	BOBL 2013-2018 0,25%	0,25	2013	—	13-IV-2018	13-IV	13-IV	5.000.000	5.123	5.000.000	1000	99,38	—
DE0001141679	BOBL 2013-2018 1%	1,00	2013	—	12-X-2018	12-X	12-X	5.000.000	591	5.000.000	0,01	99,98	—
DE0001141703	BOBL 2014-2019 0,25%	0,25	2014	—	11-X-2019	11-X	11-X	5.000.000	1.447	5.000.000	0,01	100,00	—
DE0001141695	BOBL 2014-2019 0,5%	0,50	2014	—	12-IV-2019	12-IV	12-IV	500.000	1.952	500.000	0,01	99,66	—
DE0001141687	BOBL 2014-2019 1%	1,00	2014	—	22-II-2019	22-II	22-II	5.000.000	1.479	5.000.000	1000	100,50	—
DE0001141711	BOBL 2015-2020 0%	0,00	2015	—	17-IV-2020	17-IV	17-IV	5.000.000	5.257	5.000.000	0,01	99,81	—
DE0001141729	BOBL 2015-2020 0,25%	0,25	2015	—	16-X-2020	16-X	16-X	9.000.000	948	9.000.000	0,01	100,43	—
DE0001141737	BOBL 2016-2021 0%	0,00	2016	—	09-IV-2021	09-IV	09-IV	5.000.000	503	5.000.000	0,01	101,24	—
ES00000123J2	Bonos 2011-2016 4,25%	4,25	2011	—	31-X-2016	31-X	31-X	21.181.900	6.869	21.181.900	1000	98,93	—
ES00000123Q7	Bonos 2012-2018 4,5%	4,50	2012	—	31-I-2018	31-I	31-I	9.465.500	3.268	9.465.500	1000	99,20	—
ES00000123W5	Bonos 2013-2016 3,3%	3,30	2013	—	30-VII-2016	30-VII	30-VII	16.014.000	3.552	16.014.000	1000	100,87	—
ES00000124I2	Bonos 2013-2017 2,1%	2,10	2014	—	30-IV-2017	30-IV	30-IV	9.294.500	9.128	9.294.500	1000	99,99	—
ES00000126V0	Bonos 2014-2017 0,5%	0,50	2014	—	31-X-2017	31-X	31-X	4.369.800	3.201	4.369.800	1000	99,80	—
ES00000124V5	Bonos 2014-2019 2,75%	2,75	2014	—	30-IV-2019	30-IV	30-IV	16.053.000	8.206	16.053.000	1000	101,82	—
ES00000126C0	Bonos 2014-2020 1,4%	1,40	2014	—	31-I-2020	31-I	31-I	5.800.300	8.505	5.800.300	1000	99,11	—
ES00000127D6	Bonos 2015-2018 0,25%	0,25	2015	—	30-IV-2018	30-IV	30-IV	6.239.500	29.475	6.239.500	1000	100,01	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
ES00000127H7	Bonos 2015-2020 1,15%	1,15	2015	—	30-VII-2020	30-VII	30-VII	3.218.130	12.081	3.218.130	1000	99,54	—
ES00000128A0	Bonos 2016-2019 0,25%	0,25	2016	—	31-I-2019	31-I	31-I	3.218.140	1.415	3.218.140	1000	99,88	—
ES00000126W8	Bonosei 2013-2019 0,55%	0,55	2013	—	30-XI-2019	30-XI	30-XI	5.000.000	2.373	5.000.000	1000	101,54	—
FR0119580050	BTAN 2010-2016 2,5%	2,50	2010	—	25-VII-2016	25-VII	25-VII	4.052.000	2.357	4.052.000	1	99,47	—
FR0120746609	BTAN 2011-2017 1%	1,00	2011	—	25-VII-2017	25-VII	25-VII	18.029.000	532	18.029.000	1	100,68	—
DE0001134922	Bund 1994-2024 6,25%	6,25	1994	—	04-I-2024	04-I	04-I	10.250.000	3.120	10.250.000	0,01	100,40	—
DE0001135085	Bund 1998-2028 4,75%	4,75	1998	—	04-VII-2028	04-VII	04-VII	11.250.000	20.683	11.250.000	0,01	99,73	—
DE0001135143	Bund 2000-2030 6,25%	6,25	2014	—	04-I-2030	04-I	04-I	9.250.000	591	9.250.000	0,01	100,06	—
DE0001135176	Bund 2000-2031 5,5%	5,50	2000	—	04-I-2031	04-I	04-I	17.000.000	15.744	17.000.000	0,01	99,64	—
DE0001135226	Bund 2003-2034 4,75%	4,75	2003	—	04-VII-2034	04-VII	04-VII	20.000.000	1.760	20.000.000	0,01	102,90	—
DE0001135275	Bund 2005-2037 4%	4,00	2005	—	04-I-2037	04-I	04-I	23.000.000	3.326	23.000.000	0,01	99,21	—
DE0001135309	Bund 2006-2016 4%	4,00	2006	—	04-VII-2016	04-VII	04-VII	23.000.000	3.156	23.000.000	0,01	99,87	—
DE0001135317	Bund 2006-2017 3,75%	3,75	2006	—	04-I-2017	04-I	04-I	19.000.000	3.083	19.000.000	0,01	100,28	—
DE0001135333	Bund 2007-2017 4,25%	4,25	2007	—	04-VII-2017	04-VII	04-VII	19.000.000	2.191	19.000.000	0,01	99,08	—
DE0001135341	Bund 2007-2018 4%	4,00	2007	—	04-I-2018	04-I	04-I	14.000.000	4.839	14.000.000	0,01	98,45	—
DE0001135325	Bund 2007-2039 4,25%	4,25	2007	—	04-VII-2039	04-VII	04-VII	10.000.000	2.885	10.000.000	0,01	102,51	—
DE0001135358	Bund 2008-2018 4,25%	4,25	2008	—	04-VII-2018	04-VII	04-VII	21.000.000	3.044	21.000.000	0,01	99,39	—
DE0001135374	Bund 2008-2019 3,75%	3,75	2008	—	04-I-2019	04-I	04-I	19.000.000	2.487	19.000.000	0,01	100,07	—
DE0001135366	Bund 2008-2040 4,75%	4,75	2008	—	04-VII-2040	04-VII	04-VII	4.000.000	3.071	4.000.000	0,01	97,48	—
DE0001135382	Bund 2009-2019 3,5%	3,50	2009	—	04-VII-2019	04-VII	04-VII	7.000.000	596	7.000.000	0,01	99,69	—
DE0001135390	Bund 2009-2020 3,25%	3,25	2009	—	04-I-2020	04-I	04-I	6.000.000	3.926	6.000.000	1000	98,95	—
DE0001135416	Bund 2010-2020 2,25%	2,25	2010	—	04-IX-2020	04-IX	04-IX	6.000.000	7.915	6.000.000	0,01	98,97	—
DE0001135408	Bund 2010-2020 3%	3,00	2010	—	04-VII-2020	04-VII	04-VII	6.000.000	3.806	6.000.000	0,01	100,26	—
DE0001135424	Bund 2010-2021 2,5%	2,50	2010	—	04-I-2021	04-I	04-I	6.000.000	1.972	6.000.000	0,01	99,21	—
DE0001135432	Bund 2010-2042 3,25%	3,25	2010	—	04-VII-2042	04-VII	04-VII	4.000.000	6.340	4.000.000	0,01	98,38	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
DE0001135457	Bund 2011-2021 2,25%	2,25	2011	—	04-IX-2021	04-IX	04-IX	6.000.000	2.272	6.000.000	0,01	100,88	—
DE0001135440	Bund 2011-2021 3,25%	3,25	2011	—	04-VII-2021	04-VII	04-VII	6.000.000	1.809	6.000.000	0,01	99,72	—
DE0001135465	Bund 2011-2022 2%	2,00	2011	—	04-I-2022	04-I	04-I	6.000.000	1.992	6.000.000	0,01	100,15	—
DE0001135499	Bund 2012-2022 1,5%	1,50	2012	—	04-IX-2022	04-IX	04-IX	5.000.000	5.646	5.000.000	0,01	100,76	—
DE0001135473	Bund 2012-2022 1,75%	1,75	2012	—	04-VII-2022	04-VII	04-VII	5.000.000	10.037	5.000.000	0,01	99,77	—
DE0001030542	Bund 2012-2023 0,1% Inflation Linked	0,10	2014	—	15-IV-2023	15-IV	15-IV	14.000.000	1.610	14.000.000	0,01	99,48	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
DE0001135481	Bund 2012-2044 2,5%	2,50	2012	—	04-VII-2044	04-VII	04-VII	3.000.000	36.654	3.000.000	0,01	101,93	—
DE0001141653	Bund 2013-2018 0,5%	0,50	2013	—	23-II-2018	23-II	23-II	5.000.000	9.697	5.000.000	0,01	99,87	—
DE0001102309	Bund 2013-2023 1,5%	1,50	2013	—	15-II-2023	15-II	15-II	5.000.000	5.473	5.000.000	0,01	99,41	—
DE0001102317	Bund 2013-2023 1,5%	1,50	2013	—	15-V-2023	15-V	15-V	5.000.000	96.911	5.000.000	1000	100,84	—
DE0001102325	Bund 2013-2023 2%	2,00	2013	—	15-VIII-2023	15-VIII	15-VIII	5.000.000	4.343	5.000.000	0,01	99,49	—
DE0001102366	Bund 2014-2024 1%	1,00	2014	—	15-VIII-2024	15-VIII	15-VIII	5.000.000	16.279	5.000.000	0,01	99,55	—
DE0001102358	Bund 2014-2024 1,5%	1,50	2014	—	15-V-2024	15-V	15-V	5.000.000	36.766	5.000.000	0,01	100,83	—
DE0001102341	Bund 2014-2046 2,5%	2,50	2014	—	15-VIII-2046	15-VIII	15-VIII	3.000.000	17.899	3.000.000	0,01	99,40	—
DE0001102374	Bund 2015-2025 0,5%	0,50	2015	—	15-II-2025	15-II	15-II	5.000.000	139.441	5.000.000	0,01	99,82	—
DE0001102382	Bund 2015-2025 1%	1,00	2015	—	15-VIII-2025	15-VIII	15-VIII	5.000.000	16.652	5.000.000	0,01	101,18	—
DE0001102390	Bund 2016-2026 0,5%	0,50	2016	—	15-II-2026	15-II	15-II	5.000.000	22.027	5.000.000	0,01	99,11	—
DE0001030559	Bundei 2014-2030 0,5%	0,50	2014	—	15-IV-2030	15-IV	15-IV	3.000.000	670	3.000.000	0,01	101,31	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
DE0001030567	Bundei 2015-2026 0,1%	0,10	2015	—	15-IV-2026	15-IV	15-IV	4.000.000	2.130	4.000.000	0,01	111,58	—
DE0001030526	Federal Republic of Germany 2009-2020 Inflation-Linked Bonds	1,75	2009	—	15-IV-2020	15-IV	15-IV	7.000.000	5.540	7.000.000	0,01	100,12	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
DE0001030534	Federal Republic of Germany 2011-2018 0,75%	0,75	2014	—	15-IV-2018	15-IV	15-IV	12.000.000	836	12.000.000	0,01	99,47	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
GR0128010676	GGB 2012-2023 Step Up 2% ¹⁾	3,00	2012	—	24-II-2023	24-II	24-II	2.962.803	32.077	2.962.803	1	100,00	—
GR0128011682	GGB 2012-2024 Step Up 2% ¹⁾	3,00	2012	—	24-II-2024	24-II	24-II	2.962.803	13.052	2.962.803	1	100,00	—
GR0128012698	GGB 2012-2025 Step Up 2% ¹⁾	3,00	2012	—	24-II-2025	24-II	24-II	2.962.803	8.807	2.962.803	1	100,00	—

¹⁾ Cedole fisse a crescere pari al 2% fino al 2015, 3% fino al 2020, 3,65% fino al 2021 e 4,3% fino a scadenza.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
				Primo rimborso	Ultimo rimborso									
GR0128013704	GGB 2012-2026 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2026	24-II	24-II	2.962.803	12.626	2.962.803	1	100,00	—
GR0128014710	GGB 2012-2027 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2027	24-II	24-II	2.962.803	9.074	2.962.803	1	100,00	—
GR0133006198	GGB 2012-2028 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2028	24-II	24-II	3.160.323	9.591	3.160.323	1	100,00	—
GR0133007204	GGB 2012-2029 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2029	24-II	24-II	3.160.323	11.911	3.160.323	1	100,00	—
GR0133008210	GGB 2012-2030 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2030	24-II	24-II	3.160.323	8.363	3.160.323	1	100,00	—
GR0133009226	GGB 2012-2031 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2031	24-II	24-II	3.160.323	6.602	3.160.323	1	100,00	—
GR0133010232	GGB 2012-2032 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2032	24-II	24-II	3.160.323	8.348	3.160.323	1	100,00	—
GR0138005716	GGB 2012-2033 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2033	24-II	24-II	3.160.323	12.505	3.160.323	1	100,00	—
GR0138006722	GGB 2012-2034 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2034	24-II	24-II	3.160.323	6.421	3.160.323	1	100,00	—
GR0138007738	GGB 2012-2035 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2035	24-II	24-II	3.160.323	14.283	3.160.323	1	100,00	—
GR0138008744	GGB 2012-2036 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2036	24-II	24-II	3.160.323	14.658	3.160.323	1	100,00	—
GR0138009759	GGB 2012-2037 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2037	24-II	24-II	3.160.323	20.681	3.160.323	1	100,00	—
GR0138010765	GGB 2012-2038 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2038	24-II	24-II	3.160.323	15.217	3.160.323	1	100,00	—
GR0138011771	GGB 2012-2039 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2039	24-II	24-II	3.160.323	13.358	3.160.323	1	100,00	—
GR0138012787	GGB 2012-2040 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2040	24-II	24-II	3.160.323	14.783	3.160.323	1	100,00	—
GR0138013793	GGB 2012-2041 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2041	24-II	24-II	3.160.323	18.005	3.160.323	1	100,00	—
GR0138014809	GGB 2012-2042 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2042	24-II	24-II	3.160.323	64.314	3.160.323	1	100,00	—
GR0110029312	GGB 2014-2017 3,375%	1)	3,38	2014	—	17-VII-2017	17-VII	17-VII	1.500.000	107.459	1.500.000	1000	99,65	—
GR0114028534	GGB 2014-2019 4,75%	1)	4,75	2014	—	17-IV-2019	17-IV	17-IV	3.000.000	231.541	3.000.000	1000	99,13	—
FR0000571150	OAT 1993-2025 6%	1)	6,00	1993	—	25-X-2025	25-X	25-X	12.491.928	1.066	12.491.928	1	95,29	—
FR0000571218	OAT 1997-2029 5,5%	1)	5,50	1997	—	25-IV-2029	25-IV	25-IV	15.500.880	1.645	15.500.880	1	97,68	—
FR0000187361	OAT 2000-2016 5%	1)	5,00	2000	—	25-X-2016	25-X	25-X	16.652.000	600	16.652.000	1	98,02	—
FR0000187635	OAT 2000-2032 5,75%	1)	5,75	2000	—	25-X-2032	25-X	25-X	18.738.000	2.600	18.738.000	1	99,53	—
FR0010070060	OAT 2003-2035 4,75%	1)	4,75	2003	—	25-IV-2035	25-IV	25-IV	14.664.000	530	14.664.000	1	99,54	—
FR0010192997	OAT 2005-2021 3,75%	1)	3,75	2005	—	25-IV-2021	25-IV	25-IV	12.849.000	2.775	12.849.000	1	99,92	—

1) Cedole fisse a crescere pari al 2% fino al 2015, 3% fino al 2020, 3,65% fino al 2021 e 4,3% fino a scadenza.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
FR0010371401	OAT 2005-2038 4%	4,00	2005	—	25-X-2038	25-X	25-X	4.297.000	4.437	4.297.000	1	98,25	—
FR0010415331	OAT 2006-2017 3,75%	3,75	2006	—	25-IV-2017	25-IV	25-IV	5.994.000	831	5.994.000	1	98,14	—
FR0010466938	OAT 2006-2023 4,25%	4,25	2006	—	25-X-2023	25-X	25-X	6.470.000	1.654	6.470.000	1	98,36	—
FR0010670737	OAT 2007-2018 4,25%	4,25	2007	—	25-X-2018	25-X	25-X	10.499.000	535	10.499.000	1	98,55	—
FR0010949651	OAT 2009-2020 2,5%	2,50	2009	—	25-X-2020	25-X	25-X	10.389.000	6.248	10.389.000	1	98,42	—
FR0010854182	OAT 2009-2020 3,5%	3,50	2009	—	25-IV-2020	25-IV	25-IV	5.375.000	1.502	5.375.000	1	99,30	—
FR0011059088	OAT 2010-2021 3,25%	3,25	2010	—	25-X-2021	25-X	25-X	27.953.000	6.127	27.983.000	1	97,88	—
FR0010916924	OAT 2010-2026 3,5%	3,50	2010	—	25-IV-2026	25-IV	25-IV	4.690.000	991	4.690.000	1	99,47	—
FR0011337880	OAT 2011-2022 2,25%	2,25	2012	—	25-X-2022	25-X	25-X	10.617.000	11.262	10.617.000	1	99,75	—
FR0011196856	OAT 2011-2022 3%	3,00	2011	—	25-IV-2022	25-IV	25-IV	17.255.000	2.698	17.255.000	1	98,90	—
FR0011317783	OAT 2011-2027 2,75%	2,75	2011	—	25-X-2027	25-X	25-X	3.796.000	5.109	3.796.000	1	98,82	—
FR0011394345	OAT 2012-2018 1%	1,00	2012	—	25-V-2018	25-V	25-V	16.211.000	2.049	16.211.000	1	99,71	—
FR0011486067	OAT 2012-2023 1,75%	1,75	2012	—	25-V-2023	25-V	25-V	4.291.000	3.224	4.291.000	1000	99,45	—
FR0011461037	OAT 2012-2045 3,25%	3,25	2013	—	25-V-2045	25-V	25-V	6.160.000	4.523	6.160.000	1	99,74	—
FR0011857218	OAT 2013-2016 0,25%	0,25	2014	—	25-XI-2016	25-XI	25-XI	4.370.000	531	4.370.000	0,01	99,81	—
FR0011993179	OAT 2013-2019 0,5%	0,50	2013	—	25-XI-2019	25-XI	25-XI	4.396.000	1.156	4.396.000	1	99,02	—
FR0011962398	OAT 2013-2024 1,75%	1,75	2013	—	25-XI-2024	25-XI	25-XI	5.390.000	3.174	5.390.000	1	98,01	—
FR0011619436	OAT 2013-2024 2,25%	2,25	2013	—	25-V-2024	25-V	25-V	4.283.000	1.585	4.283.000	1	98,50	—
FR0011883966	OAT 2013-2030 2,5%	2,50	2014	—	25-V-2030	25-V	25-V	4.130.000	10.130	4.130.000	1	98,18	—
FR0012557957	OAT 2014-2020 0%	0,00	2014	—	25-V-2020	25-V	25-V	8.006.000	2.721	8.006.000	1	99,46	—
FR0012517027	OAT 2014-2025 0,5%	0,50	2014	—	25-V-2025	25-V	25-V	4.625.000	19.768	4.625.000	1	98,87	—
FR0012938116	OAT 2014-2025 1%	1,00	2014	—	25-XI-2025	25-XI	25-XI	6.633.000	12.586	6.633.000	1	98,02	—
FR0012634558	OAT 2015-2018 0%	0,00	2015	—	25-II-2018	25-II	25-II	3.505.000	8.758	3.505.000	1	100,33	—
FR0013157096	OAT 2015-2021 0%	0,00	2015	—	25-V-2021	25-V	25-V	4.095.000	1.756	4.095.000	1	100,74	—
FR0013131877	OAT 2015-2026 0,5%	0,50	2015	—	25-V-2026	25-V	25-V	5.100.000	15.350	5.100.000	1	98,69	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
FR0012993103	OAT 2015-2031 1,5%	1,50	2015	—	25-V-2031	25-V	25-V	4.964.000	5.062	4.964.000	1	100,09	—
FR0013154044	OAT 2015-2036 1,25%	1,25	2015	—	25-V-2036	25-V	25-V	6.000.000	3.451	6.000.000	1	98,95	—
FR0013154028	OAT 2015-2066 1,75%	1,75	2015	—	25-V-2066	25-V	25-V	3.000.000	3.718	3.000.000	1	94,68	—
FR0010050559	OATei 2003-2020 2,25%	2,76	2003	—	25-VII-2020	25-VII	25-VII	6.454.000	1.065	6.454.000	1	98,37	—
FR0010447367	OATei 2006-2040 1,8%	2,03	2006	—	25-VII-2040	25-VII	25-VII	6.814.000	609	6.814.000	1	98,15	—
FR0010899765	OATei 2009-2022 1,1%	1,17	2009	—	25-VII-2022	25-VII	25-VII	4.023.000	1.705	4.023.000	1	97,27	—
FR0011982776	OATei 2013-2030 0,7%	0,70	2013	—	25-VII-2030	25-VII	25-VII	3.500.000	790	3.500.000	1000	99,09	—
FR0010235176	OATi 2005-2017 1%	1,14	2005	—	25-VII-2017	25-VII	25-VII	3.721.000	1.405	3.721.000	1	98,55	—
FR0010585901	OATi 2007-2023 2,1%	2,28	2007	—	25-VII-2023	25-VII	25-VII	8.153.000	760	8.153.000	1	98,69	—
ES0000011868	Obligaciones del Estado 1999-2029 6%	6,00	1999	—	31-I-2029	31-I	31-I	8.859.768	900	12.193.300	0,01	94,85	—
ES0000012783	Obligaciones del Estado 2002-2017 5,5%	5,50	2002	—	30-VII-2017	30-VII	30-VII	20.085.800	38.524	20.085.800	1000	99,46	—
ES0000012411	Obligaciones del Estado 2002-2032 5,75%	5,75	2002	—	30-VII-2032	30-VII	30-VII	10.838.193	3.930	10.915.290	1000	93,72	—
ES0000012932	Obligaciones del Estado 2005-2037 4,2%	4,20	2014	—	31-I-2037	31-I	31-I	15.994.400	8.675	15.994.400	1000	98,85	—
ES00000120J8	Obligaciones del Estado 2006-2017 3,8%	3,80	2014	—	31-I-2017	31-I	31-I	21.453.400	10.664	21.453.400	1000	99,55	—
ES00000120N0	Obligaciones del Estado 2007-2040 4,9%	4,90	2007	—	30-VII-2040	30-VII	30-VII	13.373.900	3.419	13.373.900	1000	99,66	—
ES00000121G2	Obligaciones del Estado 2008-2024 4,8%	4,80	2008	—	31-I-2024	31-I	31-I	13.814.200	739	13.814.200	1000	98,75	—
ES00000121O6	Obligaciones del Estado 2009-2019 4,3%	4,30	2009	—	31-X-2019	31-X	31-X	11.419.800	1.494	11.419.800	1000	99,08	—
ES00000122D7	Obligaciones del Estado 2010-2020 4%	4,00	2010	—	30-IV-2020	30-IV	30-IV	8.070.340	3.851	8.070.340	1000	99,22	—
ES00000122E5	Obligaciones del Estado 2010-2025 4,65%	4,65	2010	—	30-VII-2025	30-VII	30-VII	5.000.000	1.797	5.000.000	1000	99,83	—
ES00000123B9	Obligaciones del Estado 2011-2021 5,5%	5,50	2011	—	30-IV-2021	30-IV	30-IV	6.000.000	3.181	6.000.000	1000	99,23	—
ES00000123K0	Obligaciones del Estado 2011-2022 5,85%	5,85	2014	—	31-I-2022	31-I	31-I	19.001.900	1.580	19.001.900	1000	92,01	—
ES00000123C7	Obligaciones del Estado 2011-2026 5,9%	5,90	2011	—	30-VII-2026	30-VII	30-VII	4.000.000	873	4.000.000	1000	98,94	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
ES00000123X3	Obligaciones del Estado 2013-2023 4,4%	4,40	2013	—	31-X-2023	31-X	31-X	14.019.500	15.893	14.019.500	1000	99,60	—
ES00000123U9	Obligaciones del Estado 2013-2023 5,4%	5,40	2013	—	31-I-2023	31-I	31-I	10.126.200	846	10.126.200	1000	99,99	—
ES00000124C5	Obligaciones del Estado 2013-2028 5,15%	5,15	2013	—	31-X-2028	31-X	31-X	4.515.900	9.191	4.515.900	1000	99,57	—
ES00000124W3	Obligaciones del Estado 2014-2024 3,8%	3,80	2014	—	30-IV-2024	30-IV	30-IV	12.284.100	3.114	12.284.100	1000	99,64	—
ES00000126D8	Obligaciones del Estado 2014-2064 4%	4,00	2014	—	31-X-2064	31-X	31-X	1.000.000	2.202	1.000.000	1000	100,00	—
ES00000126Z1	Obligaciones del Estado 2015-2025 1,6%	1,60	2015	—	30-IV-2025	30-IV	30-IV	9.000.000	35.507	9.000.000	1000	100,00	—
ES00000127G9	Obligaciones del Estado 2015-2025 2,15%	2,15	2015	—	31-X-2025	31-X	31-X	5.000.000	64.058	5.000.000	1000	100,00	—
ES00000127A2	Obligaciones del Estado 2015-2030 1,95%	1,95	2015	—	30-VII-2030	30-VII	30-VII	7.000.000	149.745	7.000.000	1000	99,60	—
ES00000127Z9	Obligaciones del Estado 2016-2026 1,95%	1,95	2016	—	30-IV-2026	30-IV	30-IV	9.000.000	4.820	9.000.000	1000	100,00	—
ES00000128C6	Obligaciones del Estado 2016-2046 2,90%	2,90	2016	—	31-X-2046	31-X	31-X	5.000.000	34.400	5.000.000	1000	100,00	—
ES00000128E2	Obligaciones del Estado 2016-2066 3,45%	3,45	2016	—	30-VII-2066	30-VII	30-VII	3.000.000	14.486	3.000.000	1000	100,00	—
ES00000126A4	Obligacionesei 2013-2024 1,8%	1,80	2013	—	30-XI-2024	30-XI	30-XI	6.004.100	3.913	6.004.100	1000	99,66	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
ES00000127C8	Obligacionesei 2014-2030 1%	1,00	2014	—	30-XI-2030	30-XI	30-XI	3.500.000	3.969	3.500.000	1000	100,00	—
PTOTE6OE0006	Obrigacoes do Tesouro 2006-2016 4,2%	4,20	2006	—	15-X-2016	15-X	15-X	6.185.000	1.435	6.185.000	0,01	99,63	—
PTOTE5OE0007	Obrigacoes do Tesouro 2006-2037 4,1%	4,10	2014	—	15-IV-2037	15-IV	15-IV	6.973.000	433.694	6.973.000	0,01	99,60	—
PTOTELOE0010	Obrigacoes do Tesouro 2007-2017 4,35%	4,35	2014	—	16-X-2017	16-X	16-X	11.258.000	4.929	11.258.000	0,01	99,91	—
PTOTENOE0018	Obrigacoes do Tesouro 2008-2018 4,45%	4,45	2014	—	15-VI-2018	15-VI	15-VI	10.853.000	5.784	10.853.000	0,01	99,99	—
PTOTEAOE0021	Obrigacoes do Tesouro 2008-2023 4,95%	4,95	2014	—	25-X-2023	25-X	25-X	7.228.000	17.335	7.228.000	0,01	99,62	—
PTOTEMOE0027	Obrigacoes do Tesouro 2009-2019 4,75%	4,75	2014	—	14-VI-2019	14-VI	14-VI	10.915.000	3.793	10.915.000	0,01	99,97	—
PTOTECOEO029	Obrigacoes do Tesouro 2010-2020 4,8%	4,80	2014	—	15-VI-2020	15-VI	15-VI	8.551.000	6.880	8.551.000	0,01	99,84	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
PTOTEQOE0015	Obrigacoes do Tesouro 2013-2024 5,65%	5,65	2014	—	15-II-2024	15-II	15-II	6.000.000	7.880	6.000.000	0,01	99,88	—
PTOTEROE0014	Obrigacoes do Tesouro 2014-2030 3,875%	3,87	2014	—	15-II-2030	15-II	15-II	3.500.000	19.553	3.500.000	0,01	99,47	—
PTOTESOE0013	Obrigacoes do Tesouro 2015-2022 2,2%	2,20	2015	—	17-X-2022	17-X	17-X	3.000.000	37.610	3.000.000	0,01	99,74	—
PTOTEKOE0011	Obrigacoes do Tesouro 2015-2025 2,87%	2,87	2015	—	15-X-2025	15-X	15-X	3.500.000	102.119	3.500.000	0,01	99,60	—
PTOTEBOE0020	Obrigacoes do Tesouro 2015-2045 4,1%	4,10	2015	—	15-II-2045	15-II	15-II	2.000.000	342.662	2.000.000	0,01	99,47	—
PTOTETOE0012	Obrigacoes do Tesouro 2016-2026 2,875%	2,88	2016	—	21-VII-2026	21-VII	21-VII	4.000.000	84.323	4.000.000	0,01	100,00	—
NL0010071189	Regno dei Paesi Bassi 2012-2033 2,5%	2,50	2014	—	15-I-2033	15-I	15-I	10.048.900	2.031	10.048.900	1	96,29	—
NL0010661930	Regno dei Paesi Bassi 2014-2017 0,5%	0,50	2014	—	15-IV-2017	15-IV	15-IV	12.172.000	5.353	12.172.000	1	99,77	—
NL0010733424	Regno dei Paesi Bassi 2014-2019 2%	2,00	2014	—	15-VII-2024	15-VII	15-VII	11.342.132	1.627	11.342.132	1	100,30	—
BE0000291972	Regno del Belgio 1997-2028 5,5%	5,50	2013	—	28-III-2028	28-III	28-III	16.638.939	4.597	16.638.939	0,01	98,93	—
BE0000312216	Regno del Belgio 2008-2018 4%	4,00	2014	—	28-III-2018	28-III	28-III	11.428.000	2.747	11.428.000	0,01	98,03	—
BE0000318270	Regno del Belgio 2010-2020 3,75%	3,75	2013	—	28-IX-2020	28-IX	28-IX	17.634.000	800	17.634.000	0,01	99,03	—
BE0000323320	Regno del Belgio 2011-2017 3,5%	3,50	2014	—	28-VI-2017	28-VI	28-VI	13.234.000	1.847	13.234.000	0,01	98,81	—
BE0000321308	Regno del Belgio 2011-2021 4,25%	4,25	2014	—	28-IX-2021	28-IX	28-IX	14.921.000	3.899	14.921.000	0,01	98,97	—
BE0000324336	Regno del Belgio 2011-2026 4,5%	4,50	2011	—	28-III-2026	28-III	28-III	9.040.000	1.334	9.040.000	0,01	99,75	—
BE0000325341	Regno del Belgio 2012-2022 4,25%	4,25	2012	—	28-IX-2022	28-IX	28-IX	15.417.000	764	15.417.000	0,01	99,58	—
BE0000326356	Regno del Belgio 2012-2032 4%	4,00	2013	—	28-III-2032	28-III	28-III	8.204.000	773	8.204.000	0,01	99,13	—
BE0000329384	Regno del Belgio 2013-2018 1,25%	1,25	2013	—	22-VI-2018	22-VI	22-VI	11.890.000	1.233	11.890.000	0,01	99,76	—
BE6253986085	Regno del Belgio 2013-2018 1,5% USD	1,50	2013	—	22-VI-2018	22-VI	22-VI	USD 1.000.000	USD 1.505	USD 1.000.000	USD 1.000	99,63	—
BE0000328378	Regno del Belgio 2013-2023 2,25%	2,25	2013	—	22-VI-2023	22-VI	22-VI	11.917.000	1.134	11.917.000	0,01	99,01	—
BE0000334434	Regno del Belgio 2015-2025 0,8%	0,80	2015	—	22-VI-2025	22-VI	22-VI	5.000.000	3.501	5.000.000	0,01	99,18	—
BE0000335449	Regno del Belgio 2015-2031 1%	1,00	2015	—	22-VI-2031	22-VI	22-VI	4.000.000	21.377	4.000.000	0,01	99,06	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
BE0000336454	Regno del Belgio 2015-2038 1,9%	1,90	2015	—	22-VI-2038	22-VI	22-VI	4.000.000	2.052	4.000.000	0,01	100,00	—
BE0000338476	Regno del Belgio 2016-2047 1,6%	1,60	2016	—	22-VI-2047	22-VI	22-VI	3.500.000	6.816	3.500.000	0,01	100,00	—
NL0000102317	Regno d'Olanda 1998-2028 5,5%	5,50	1998	—	15-I-2028	15-I	15-I	13.028.814	803	13.028.814	1	100,27	—
NL0000102234	Regno d'Olanda 2005-2037 4%	4,00	2005	—	15-I-2037	15-I	15-I	13.637.427	590	13.637.427	1	98,73	—
NL0009086115	Regno d'Olanda 2009-2019 4%	4,00	2009	—	15-VII-2019	15-VII	15-VII	13.006.398	661	13.006.398	1	99,07	—
NL0010060257	Regno d'Olanda 2012-2022 2,25%	2,25	2012	—	15-VII-2022	15-VII	15-VII	15.252.147	565	15.252.147	1	99,00	—
NL0010418810	Regno d'Olanda 2013-2023 1,75%	1,75	2013	—	15-VII-2023	15-VII	15-VII	15.533.963	535	15.533.963	1	99,25	—
NL0011005137	Regno d'Olanda 2015-2018 0%	0,00	2015	—	15-IV-2018	15-IV	15-IV	12.433.000	1.478	12.433.000	1	100,11	—
NL0011220108	Regno d'Olanda 2015-2025 0,25%	0,25	2015	—	15-VII-2025	15-VII	15-VII	11.772.159	6.450	11.772.159	1	98,62	—
IT0006527532	Repubblica Ellenica 1999-2019 5%	5,00	1999	—	11-III-2019	11-III	11-III	200.000	21.446	200.000	1000	100,00	—
FI4000029715	Repubblica Finlandese 2011-2017 1,87%	1,87	2011	—	15-IV-2017	15-IV	15-IV	5.000.000	1.261	5.000.000	1000	99,75	—
FI4000020961	Repubblica Finlandese 2011-2021 3,5%	3,50	2011	—	15-IV-2021	15-IV	15-IV	6.000.000	546	6.000.000	1000	99,16	—
FI4000047089	Repubblica Finlandese 2012-2022 1,62%	1,62	2014	—	15-IX-2022	15-IX	15-IX	500.000	2.664	500.000	1000	98,90	—
FI4000037635	Repubblica Finlandese 2012-2028 2,75%	2,75	2012	—	04-VII-2028	04-VII	04-VII	4.000.000	648	4.000.000	1000	98,41	—
FI4000046545	Repubblica Finlandese 2012-2042 2,62%	2,62	2012	—	04-VII-2042	04-VII	04-VII	3.501.000	1.002	3.501.000	1000	99,53	—
FI4000068663	Repubblica Finlandese 2013-2018 1,12%	1,12	2013	—	15-IX-2018	15-IX	15-IX	5.001.000	701	5.001.000	1000	99,73	—
FI4000106117	Repubblica Finlandese 2014-2020 0,37%	0,37	2014	—	15-IX-2020	15-IX	15-IX	5.001.000	1.672	5.001.000	1000	99,41	—
FI4000148630	Repubblica Finlandese 2015-2031 0,75%	0,75	2015	—	15-IV-2031	15-IV	15-IV	3.000.000	20.485	3.000.000	1000	98,59	—
FI4000197959	Repubblica Finlandese 2016-2026 0,5%	0,50	2016	—	15-IV-2026	15-IV	15-IV	4.000.000	596	4.000.000	1000	100,00	—
US731011AR30	Repubblica Polacca 2009-2019 6,375% USD	6,38	2009	—	15-VII-2019	15-I	15-VII	USD 3.500.000	USD 588	USD 3.500.000	USD 1.000	99,79	—
US857524AA08	Repubblica Polacca 2011-2021 5,125% USD	5,13	2011	—	21-IV-2021	21-IV	21-IV	USD 2.000.000	USD 839	USD 2.000.000	USD 1.000	98,83	—
US857524AB80	Repubblica Polacca 2011-2022 5% USD	5,00	2011	—	23-III-2022	23-III	23-III	USD 3.000.000	USD 2.500	USD 3.000.000	USD 1.000	98,61	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
US731011AT95	Repubblica Polacca 2012-2023 3% USD	3,00	2012	—	17-III-2023	17-III	17-III	USD 2.000.000	USD 96.365	USD 2.000.000	USD 1.000	98,45	—
US857524AC63	Repubblica Polacca 2014-2024 4% USD	4,00	2014	—	22-I-2024	22-I	22-I	USD 2.000.000	USD 3.269	USD 2.000.000	USD 1.000	99,19	—
XS1288467605	Repubblica Polacca 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	09-IX-2025	09-IX	09-IX	1.000.000	3.446	1.000.000	1000	99,16	—
XS1209947271	Repubblica Polacca 2015-2027 0,875%	0,88	2015	—	10-V-2027	10-V	10-V	1.000.000	4.462	1.000.000	1000	98,34	—
XS1346201616	Repubblica Polacca 2016-2026 1,5%	1,50	2016	—	19-I-2026	19-I	19-I	1.000.000	1.448	1.000.000	1000	99,61	—
US731011AU68	Repubblica Polacca 2016-2026 3,25% USD	3,25	2016	—	06-IV-2026	06-IV	06-IV	USD 1.750.000	USD 4.393	USD 1.750.000	USD 1.000	99,25	—
XS1346201889	Repubblica Polacca 2016-2036 2,375%	2,38	2016	—	18-I-2036	18-I	18-I	750.000	4.588	750.000	1000	100,00	—
XS1085735899	Repubblica Portoghese 2014-2024 5,12% USD	5,12	2014	—	15-X-2024	15-IV	15-X	USD 4.500.000	USD 178.983	USD 4.500.000	USD 1.000	99,22	—
AT0000383864	Republic of Austria 1997-2027 6,25%	6,25	2014	—	15-VII-2027	15-VII	15-VII	7.131.099	1.069	7.131.099	0,01	99,45	—
AT0000385745	Republic of Austria 2003-2018 4,65%	4,65	2003	—	15-I-2018	15-I	15-I	11.256.606	1.259	11.256.606	1000	99,74	—
AT0000386115	Republic of Austria 2004-2020 3,9%	3,90	2004	—	15-VII-2020	15-VII	15-VII	11.672.610	4.437	11.672.610	1000	99,15	—
AT0000A011T9	Republic of Austria 2005-2016 4%	4,00	2005	—	15-IX-2016	15-IX	15-IX	10.280.000	1.203	10.280.000	1000	99,81	—
XS0216258763	Republic of Austria 2005-2020 CMS Spread Floater Notes	0,28	2005	—	22-IV-2020	22-IV	22-IV	200.000	4.274	200.000	1000	100,00	—
XS0221500571	Republic of Austria 2005-2020 FRN Capped	0,18	2005	—	29-VI-2020	29-III; 29-IX	29-VI	100.000	2.496	100.000	1000	100,00	—
AT0000A001X2	Republic of Austria 2005-2021 3,5%	3,50	2005	—	15-IX-2021	15-IX	15-IX	12.910.820	1.005	12.910.820	1000	99,80	—
IT0006592080	Republic of Austria 2005-2022 CMS-Linked Flippable	0,09	2005	—	22-VI-2022	22-VI	22-VI	125.000	2.778	125.000	1000	100,00	—
XS0229808315	Republic of Austria 2005-2025 CMS Spread-Linked	0,68	2005	—	10-X-2025	10-IV	10-X	120.000	32.003	120.000	1000	100,00	—
XS0224713254	Republic of Austria 2005-2025 CMS-Linked	1,04	2005	—	28-VII-2025	28-VII	28-VII	50.000	2.268	50.000	1000	100,00	—
XS0231558858	Republic of Austria 2005-2035 Fixed to CMS-Linked	0,38	2005	—	24-X-2035	24-X	24-X	75.000	9.088	75.000	1000	100,00	—
AT0000A04967	Republic of Austria 2006-2037 4,15%	4,15	2006	—	15-III-2037	15-III	15-III	9.861.598	1.263	9.861.598	1000	99,72	—
AT0000A06P24	Republic of Austria 2007-2017 4,3%	4,30	2007	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	6.719.300	839	6.719.300	1000	99,55	—
AT0000A08968	Republic of Austria 2007-2019 4,35%	4,35	2007	—	15-III-2019	15-III	15-III	11.317.729	625	11.317.729	1000	99,90	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
AT0000A0DXC2	Republic of Austria 2009-2026 4,85%	4,85	2009	—	15-III-2026	15-III	15-III	5.355.801	533	5.355.801	1000	99,79	—
AT0000A0GLY4	Republic of Austria 2010-2017 3,2%	3,20	2010	—	20-II-2017	20-II	20-II	9.876.665	1.250	9.876.665	1000	99,81	—
AT0000A0N9A0	Republic of Austria 2011-2022 3,65%	3,65	2013	—	20-IV-2022	20-IV	20-IV	7.875.171	659	7.875.171	1000	99,66	—
AT0000A0VRF9	Republic of Austria 2012-2019 1,95%	1,95	2013	—	18-VI-2019	18-VI	18-VI	6.673.921	593	6.673.921	1000	99,55	—
AT0000A0U3T4	Republic of Austria 2012-2022 3,4%	3,40	2013	—	22-XI-2022	22-XI	22-XI	9.159.700	1.245	9.159.700	1000	99,71	—
AT0000A12B06	Republic of Austria 2013-2018 1,15%	1,15	2014	—	19-X-2018	19-X	19-X	6.420.000	1.158	6.420.000	1000	99,85	—
AT0000A105W3	Republic of Austria 2013-2023 1,75%	1,75	2013	—	20-X-2023	20-X	20-X	6.036.750	1.034	6.036.750	1000	99,74	—
AT0000A10683	Republic of Austria 2013-2034 2,4%	2,40	2013	—	23-V-2034	23-V	23-V	2.160.000	4.477	2.160.000	1000	99,38	—
AT0000A19XC3	Republic of Austria 2014-2019 0,25%	0,25	2014	—	18-X-2019	18-X	18-X	4.000.000	1.344	4.000.000	1000	100,00	—
AT0000A1FAP5	Republic of Austria 2015-2025 1,2%	1,20	2015	—	20-X-2025	20-X	20-X	4.000.000	1.499	4.000.000	1000	99,45	—
AT0000A1K9C8	Republic of Austria 2016-2026 0,75%	0,75	2016	—	20-X-2026	20-X	20-X	3.500.000	2.803	3.500.000	1000	99,91	—
AT0000A1K9F1	Republic of Austria 2016-2047 1,5%	1,50	2016	—	20-II-2047	20-II	20-II	1.500.000	3.965	1.500.000	1000	99,93	—
IE0034074488	Republic of Ireland 2004-2020 4,5%	4,50	2004	—	18-IV-2020	18-IV	18-IV	11.608.770	2.939	11.608.770	0,01	97,72	—
IE00B28HXX02	Republic of Ireland 2007-2018 4,5%	4,50	2007	—	18-X-2018	18-X	18-X	9.255.580	2.069	9.255.580	0,01	99,31	—
IE00B2QTFG59	Republic of Ireland 2008-2019 4,4%	4,40	2008	—	18-VI-2019	18-VI	18-VI	7.700.060	559	7.700.060	0,01	99,03	—
IE00B4TV0D44	Republic of Ireland 2009-2025 5,4%	5,40	2009	—	13-III-2025	13-III	13-III	11.745.350	1.741	11.745.350	0,01	99,30	—
IE00B60Z6194	Republic of Ireland 2010-2020 5%	5,00	2010	—	18-X-2020	18-X	18-X	9.051.990	1.027	9.051.990	0,01	99,28	—
IE00B4S3JD47	Republic of Ireland 2013-2023 3,9%	3,90	2013	—	20-III-2023	20-III	20-III	5.479.500	805	5.479.500	0,01	97,99	—
IE00B6X95T99	Republic of Ireland 2014-2024 3,4%	3,40	2014	—	18-III-2024	18-III	18-III	8.136.950	701	8.136.950	0,01	100,00	—
IE00BJ38CR43	Republic of Ireland 2014-2030 2,4%	2,40	2014	—	15-V-2030	15-V	15-V	3.750.000	4.842	3.750.000	0,01	98,90	—
IE00BJ38CQ36	Republic of Ireland 2015-2022 0,8%	0,80	2015	—	15-III-2022	15-III	15-III	4.000.000	2.361	4.000.000	0,01	99,54	—
IE00BV8C9186	Republic of Ireland 2015-2045 2%	2,00	2015	—	18-II-2045	18-II	18-II	4.000.000	45.554	4.000.000	0,01	100,00	—
IE00BV8C9418	Republic of Ireland 2016-2026 1%	1,00	2016	—	15-V-2026	15-V	15-V	3.000.000	2.815	3.000.000	0,01	98,49	—
DE0001137479	Schatz 2014-2016 0%	0,00	2014	—	16-IX-2016	16-IX	16-IX	5.000.000	8.538	5.000.000	0,01	100,01	—
DE0001137487	Schatz 2014-2016 0%	0,00	2014	—	16-XII-2016	16-XII	16-XII	5.000.000	11.534	5.000.000	0,01	100,11	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
DE0001104602	Schatz 2015-2017 0%	0,00	2015	—	16-VI-2017	16-VI	16-VI	5.000.000	1.607	5.000.000	0,01	100,45	—
DE0001104610	Schatz 2015-2017 0%	0,00	2015	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	5.000.000	954	5.000.000	0,01	100,52	—
DE0001104628	Schatz 2015-2017 0%	0,00	2015	—	15-XII-2017	15-XII	15-XII	5.000.000	1.390	5.000.000	0,01	100,80	—
DE0001137495	Schatz 2015-2017 0%	0,00	2015	—	10-III-2017	10-III	10-III	5.000.000	6.750	5.000.000	0,01	100,45	—
DI ENTI E SOCIETÀ													
IT0005159543	4 Madonne Caseificio dell'Emilia 2016-2022 5% Amortizing	5,00	2016	—	27-I-2022	27-I	27-I	6.000	4.240	6.000	5000	100,00	Rimborso in rate annuali a partire dal 27-I-2018.
XS0463509959	A2A 2009-2016 4,5%	4,50	2009	—	02-XI-2016	02-XI	02-XI	1.000.000	3.050	1.000.000	1000	99,26	—
XS0859920406	A2A 2012-2019 4,5%	4,50	2012	—	28-XI-2019	28-XI	28-XI	750.000	2.300	750.000	1000	99,72	—
XS0951567030	A2A 2013-2021 4,375%	4,38	2013	—	10-I-2021	10-I	10-I	500.000	2.200	500.000	100000	99,32	—
XS1004874621	A2A 2013-2022 3,625%	3,63	2013	—	13-I-2022	13-I	13-I	500.000	1.100	500.000	1000	99,56	—
XS1195347478	A2A 2015-2025 1,75%	1,75	2015	—	25-II-2025	25-II	25-II	300.000	2.000	300.000	1000	99,92	—
XS1087831688	Acea 2014-2024 2,625%	2,63	2014	—	15-VII-2024	15-VII	15-VII	600.000	600	600.000	1000	99,20	—
IT0005075533	Alerion Clean Power 2015-2022 6% Callable	6,00	2015	—	11-II-2022	11-II	11-II	130.000	59.053	130.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato volontario totale o parziale a partire dal 12-II-2018, con preavviso di almeno 15 giorni.
XS0452314536	Assicurazioni Generali 2009-2024 5,125%	5,13	2009	—	16-IX-2024	16-IX	16-IX	1.750.000	8.400	1.750.000	1000	98,55	—
XS1014759648	Assicurazioni Generali 2014-2020 2,875%	2,88	2014	—	14-I-2020	14-I	14-I	1.250.000	1.600	1.250.000	1000	99,60	—
XS0542522692	Atlantia 2010-2017 3,375%	3,38	2010	—	18-IX-2017	18-IX	18-IX	1.000.000	650	1.000.000	1000	99,45	—
XS0542534192	Atlantia 2010-2025 4,375%	4,38	2010	—	18-IX-2025	18-IX	18-IX	500.000	1.100	500.000	1000	99,37	—
IT0004869985	Atlantia 2012-2018 3,625%	3,63	2012	—	30-XI-2018	30-XI	30-XI	1.000.000	24.759	1.000.000	1000	99,59	—
XS0828749761	Atlantia 2012-2020 4,375%	4,38	2012	—	16-III-2020	16-III	16-III	750.000	600	750.000	1000	99,44	—
XS0986174851	Atlantia 2013-2021 2,875%	2,88	2013	—	26-II-2021	26-II	26-II	750.000	600	750.000	1000	99,17	—
IT0005108490	Autostrade per l'Italia 2015-2023 1,625%	1,63	2015	—	12-VI-2023	12-VI	12-VI	750.000	365.325	750.000	1000	99,25	—
XS1327504087	Autostrade per l'Italia 2015-2026 1,75%	1,75	2015	—	26-VI-2026	26-VI	26-VI	750.000	1.000	750.000	1000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
IT0001330411	Banca Carige 1999-2019 Indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni con Floor 4%	4,00	1999	—	17-V-2019	17-V	17-V
XS0570270370	Banca Carige 2010-2020 7,321%	7,32	2014	—	20-XII-2020	20-XII	20-XII
IT0000966017	Banca Commerciale Italiana 1997-2027 Zero Coupon	—	1997	—	08-I-2027	—	08-I
IT0001200390	Banca Commerciale Italiana 1998-2028 Zero Coupon	—	1998	—	17-II-2028	—	17-II
IT0004648694	Banca IMI 2010-2017 Tasso Misto ¹⁾	0,00	2010	—	10-XI-2017	10-XI	10-XI
IT0004611932	Banca IMI 2010-2017 Tasso Variabile con Tasso Minimo	0,37	2010	—	30-VI-2017	30-VI	30-VI
IT0004694086	Banca IMI 2011-2017 Tasso Misto ²⁾	0,83	2011	—	31-III-2017	31-III	31-III
IT0004796451	Banca IMI 2012-2018 Collezione Step Up ³⁾	4,55	2012	—	06-III-2018	06-III	06-III
IT0004863723	Banca IMI 2012-2019 4,1%	4,10	2012	—	18-X-2019	18-X	18-X
IT0004863731	Banca IMI 2012-2019 4,4% USD	4,40	2012	—	18-X-2019	18-X	18-X
IT0004977671	Banca IMI 2013-2016 7,95% ZAR	7,95	2013	—	29-XI-2016	29-XI	29-XI
IT0004960354	Banca IMI 2013-2017 4,35% NOK	4,35	2013	—	13-IX-2017	13-IX	13-IX
IT0004918402	Banca IMI 2013-2018 2,3% CHF	2,30	2013	—	19-IV-2018	19-IV	19-IV
IT0004892755	Banca IMI 2013-2018 3,4% USD	3,40	2013	—	12-II-2018	12-II	12-II
IT0004938269	Banca IMI 2013-2018 6,4% AUD	6,40	2013	—	28-VI-2018	28-VI	28-VI
IT0004977739	Banca IMI 2013-2019 4% CAD	4,00	2013	—	29-XI-2019	29-XI	29-XI
IT0004936545	Banca IMI 2013-2019 4,5% Sprint BancoPosta	3,20	2013	—	30-VIII-2019	30-VIII	30-VIII
IT0004960362	Banca IMI 2013-2019 4,5% USD	4,50	2013	—	13-IX-2019	13-IX	13-IX
IT0004957020	Banca IMI 2013-2019 Tasso Fisso Sprint BancoPosta ⁵⁾	3,15	2014	—	31-X-2019	31-X	31-X
IT0004906308	Banca IMI 2013-2019 Tasso Misto Cap&Floor ⁶⁾	0,61	2013	—	31-V-2019	31-II; 31-VIII	31-V
IT0004966229	Banca IMI 2013-2020 Collezione Opportunità USD ⁷⁾	1,32	2013	—	18-X-2020	18-X	18-X
IT0005068090	Banca IMI 2014-2016 10% BRL	10,00	2014	—	27-XI-2016	27-XI	27-XI

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
25.000	8.361	25.000	1000	100,00	—	
200.000	16.000	200.000	1000	100,00	—	
263.775	52.290	339.312	0,01	10,85	—	
383.634	103.292	516.457	0,01	18,65	—	
13.515	5.465	13.515	1000	100,00	—	
423.704	152.613	423.704	1000	100,00	—	
185.832	43.893	230.832	1000	100,00	—	
46.740	4.155	100.000	1000	99,25	—	
150.000	1.709	150.000	1000	99,61	—	
USD 150.000	USD 7.060	USD 150.000	USD	2.000	99,45	—
ZAR 3.400.000	ZAR 67.840	ZAR 3.400.000	ZAR	20.000	99,77	—
NOK 2.100.000	NOK 55.665	NOK 2.100.000	NOK	15.000	99,10	—
CHF 150.000	CHF 1.172	CHF 150.000	CHF	1.000	99,78	—
USD 150.000	USD 12.756	USD 150.000	USD	2.000	99,60	—
AUD 300.000	AUD 22.128	AUD 300.000	AUD	1.000	98,80	—
CAD 350.000	CAD 9.876	CAD 350.000	CAD	2.000	99,84	—
209.526	14.506	209.526	1000	100,00	—	
USD 300.000	USD 34.848	USD 300.000	USD	2.000	99,20	—
200.869	14.806	200.869	1000	100,00	—	
178.374	38.704	178.374	1000	100,00	—	
USD 350.000	USD 96.598	USD 350.000	USD	2.000	99,94	—
BRL 750.000	BRL 83.530	BRL 750.000	BRL	5.000	99,88	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 2,2%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse a crescere pari al 2,9%, 3,3%, 3,7%, 4,1% e 4,5% annuo fino al 2016. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse a crescere pari al 3,35%, 3,65%, 3,95%, 4,25%, 4,55% e 4,85% annuo. - 4) Cedole pari al 4,5% per il primo e l'ultimo anno e al 3,2% per il secondo, terzo, quarto e quinto anno. - 5) Cedole fisse pari al 4,55% annuo la prima e l'ultima cedola, 3,15% annuo le restanti cedole. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 4,6%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0005026833	Banca IMI 2014-2017 8,6% TRY	8,60	2014	—	17-VI-2017	17-VI	17-VI	TRY 700.000	TRY 25.272	TRY 700.000	TRY 4.000	99,62	—
IT0004990310	Banca IMI 2014-2019 3,55% NOK	3,55	2014	—	28-I-2019	28-I	28-I	NOK 1.950.000	NOK 26.520	NOK 1.950.000	NOK 15.000	99,74	—
IT0005026825	Banca IMI 2014-2019 4,2% AUD	4,20	2014	—	17-VI-2019	17-VI	17-VI	AUD 370.000	AUD 20.560	AUD 370.000	AUD 2.000	99,66	—
IT0004990161	Banca IMI 2014-2019 5,2% AUD	5,20	2014	—	28-I-2019	28-I	28-I	AUD 400.000	AUD 21.464	AUD 400.000	AUD 2.000	99,74	—
IT0005045247	Banca IMI 2014-2019 5,2% NZD	5,20	2014	—	08-IX-2019	08-IX	08-IX	NZD 350.000	NZD 32.454	NZD 350.000	NZD 2.000	99,63	—
IT0005001521	Banca IMI 2014-2019 Collezione Tasso Misto Serie I NZD ¹⁾	3,13	2014	—	13-III-2019	13-III	13-III	NZD 350.000	NZD 10.952	NZD 350.000	NZD 2.500	99,83	—
IT0005001422	Banca IMI 2014-2019 Collezione Tasso Misto Serie I USD ²⁾	0,84	2014	—	13-III-2019	13-III	13-III	USD 350.000	USD 49.928	USD 350.000	USD 2.000	99,85	—
IT0005045221	Banca IMI 2014-2020 4,3% AUD	4,30	2014	—	08-IX-2020	08-IX	08-IX	AUD 350.000	AUD 36.534	AUD 350.000	AUD 2.000	99,64	—
IT0005038630	Banca Imi 2014-2021 1,6% Onestep BancoPosta ³⁾	1,60	2014	—	22-IX-2021	22-IX	22-IX	7.359	1.572	7.359	1000	100,00	—
IT0005068116	Banca IMI 2014-2021 3% USD	3,00	2014	—	27-XI-2021	27-XI	27-XI	USD 300.000	USD 35.062	USD 300.000	USD 2.000	100,00	—
IT0005075509	Banca IMI 2015-2020 4,9% NZD	4,90	2015	—	22-I-2020	22-I	22-I	NZD 350.000	NZD 19.224	NZD 350.000	NZD 2.000	99,55	—
IT0005075517	Banca IMI 2015-2020 8% TRY	8,00	2015	—	22-I-2020	22-I	22-I	TRY 700.000	TRY 22.884	TRY 700.000	TRY 4.000	99,79	—
XS1251080831	Banca Imi 2015-2021 4,35% AUD	4,35	2015	—	26-VI-2021	26-VI	26-VI	AUD 350.000	AUD 89.790	AUD 350.000	AUD 2.000	99,80	—
XS1251080088	Banca Imi 2015-2022 3,5% USD	3,50	2015	—	26-VI-2022	26-VI	26-VI	USD 280.000	USD 126.670	USD 280.000	USD 2.000	99,80	—
IT0005114357	Banca IMI 2015-2022 Collezione Tasso Misto Serie I GBP ⁴⁾	3,30	2015	—	14-V-2022	14-V	14-V	GBP 180.000	GBP 10.837	GBP 180.000	GBP 1.000	99,63	—
IT0005114365	Banca IMI 2015-2022 Collezione Tasso Misto serie II USD ⁵⁾	3,60	2015	—	14-V-2022	14-V	14-V	USD 260.000	USD 37.334	USD 260.000	USD 2.000	99,66	—
XS1341083639	Banca IMI 2016-2023 Collezione Tasso Misto serie III USD ⁶⁾	4,50	2016	—	26-I-2023	26-I	26-I	USD 260.000	USD 117.208	USD 260.000	USD 2.000	98,34	—
XS1378969072	Banca IMI 2016-2024 Collezione Tasso Misto Serie IV USD ⁷⁾	1,00	2016	—	10-V-2024	10-II; 10-VIII	10-V	USD 340.000	USD 52.296	USD 340.000	USD 2.000	99,50	—
XS1341083555	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto serie I ⁸⁾	3,10	2016	—	26-I-2026	26-I	26-I	500.000	241.176	500.000	1000	99,22	—
XS1379091546	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto Serie II	2,20	2016	—	10-V-2026	10-II; 10-VIII	10-V	500.000	79.331	500.000	1000	99,42	—
XS0467864160	Banca Intesa 2009-2016 3,75%	3,75	2009	—	23-XI-2016	23-XI	23-XI	1.500.000	9.400	1.500.000	50000	99,40	—
XS0236480322	Banca Monte dei Paschi di Siena 2005-2017 Tasso Variabile	0,27	2014	—	30-XI-2017	30-II; 30-VIII	30-XI	369.000	22.900	369.000	50000	99,68	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 5,9%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse pari al 2,5% annuo la prima cedola e 1,6% annuo le restanti cedole. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 3,3%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 3,6%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 4,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al V-2019 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 8) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 3,1%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0001302733	Banca Monte dei Paschi di Siena 1999-2029 Tasso Misto 4A	0,00	1999	—	01-II-2029	01-II	01-II	39.318	11.289	100.000	1000	100,00	—
IT0001308508	Banca Monte dei Paschi di Siena 1999-2029 Tasso Misto 8A	0,00	1999	—	15-II-2029	15-II	15-II	34.484	8.470	48.973	1000	100,00	—
XS0238916620	Banca Monte dei Paschi di Siena 2005-2018 Tasso Variabile	0,25	2005	—	15-I-2018	15-I; 15-VII	15-I	104.050	750	104.050	50000	99,36	—
XS0503326083	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5%	5,00	2010	—	21-IV-2020	21-IV	21-IV	500.000	40.350	500.000	50000	99,01	—
XS0540544912	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5,6%	5,60	2010	—	09-IX-2020	09-IX	09-IX	500.000	28.300	500.000	50000	99,01	—
IT0004771710	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 StepByStep BancoPosta ¹⁾	5,90	2011	—	30-XI-2017	30-XI	30-XI	434.414	71.163	434.414	1000	100,00	—
IT0004739576	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor BancoPosta ²⁾	4,40	2011	—	29-IX-2017	29-III	29-IX	410.000	89.123	410.000	1000	100,00	—
IT0004761356	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor BancoPosta ³⁾	4,60	2011	—	27-X-2017	27-IV	27-X	446.932	73.189	446.932	1000	100,00	—
XS1051696398	Banca Monte dei Paschi di Siena 2014-2019 3,625%	3,63	2014	—	01-IV-2019	01-IV	01-IV	1.000.000	16.200	1.000.000	1000	99,46	—
XS0597182665	Banca Popolare di Milano 2011-2021 7,125%	7,13	2011	—	01-III-2021	01-III	01-III	400.000	35.500	400.000	1000	99,60	—
XS1205644047	Banca Popolare di Vicenza 2,75%	2,75	2015	—	20-III-2020	20-III	20-III	750.000	66.600	750.000	1000	99,00	—
XS0985326502	Banca Popolare di Vicenza 2013-2018 5%	5,00	2013	—	25-X-2018	25-X	25-X	400.000	46.300	400.000	1000	99,46	—
XS1017615920	Banca Popolare di Vicenza 2014-2017 3,5%	3,50	2014	—	20-I-2017	20-I	20-I	500.000	112.700	500.000	1000	99,46	—
XS0555834984	Banco Popolare 2010-2020 6%	6,00	2010	—	05-XI-2020	05-XI	05-XI	1.000.000	77.850	1.000.000	1000	99,65	—
IT0004703317	Banco Popolare 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor ⁴⁾	4,25	2011	—	31-V-2017	31-V	31-V	430.000	35.454	500.000	1000	100,00	—
IT0004723893	Banco Popolare 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor Banco Posta Serie 2 ⁵⁾	4,00	2011	—	21-VII-2017	21-I	21-VII	548.202	38.973	548.202	1000	100,00	—
XS0632503412	Banco Popolare 2011-2021 6,375%	6,38	2011	—	31-V-2021	31-V	31-V	660.693	25.950	660.693	1000	99,26	—
XS1070681397	Banco Popolare 2014-2018 2,375%	2,38	2014	—	22-I-2018	22-I	22-I	750.000	32.200	750.000	1000	99,69	—
XS1044894944	Banco Popolare 2014-2019 3,5%	3,50	2014	—	14-III-2019	14-III	14-III	1.250.000	36.000	1.250.000	1000	99,64	—

1) Cedole fisse a crescere pari al 5,1%, 5,3%, 5,5%, 5,7%, 5,9% e 6,1% annuo. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 5,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 5,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 4,85%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1293577208	Banco Popolare 2015-2018 2,625%	2,63	2015	—	21-IX-2018	21-IX	21-IX	500.000	12.700	500.000	1000	99,82	—
XS1266866927	Banco Popolare 2015-2020 2,75%	2,75	2015	—	27-VII-2020	27-VII	27-VII	1.000.000	138.000	1.000.000	1000	99,55	—
IT0005120313	Banco Popolare 2015-2022 Tier2 Tasso Variabile Callable	1,03	2015	—	30-VII-2022	30-I; 30-VII	30-VII	499.930	364.567	499.930	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato, con preavviso di almeno 5 giorni.
IT0001271003	BIM-IMI 1998-2018 Step-Down con Premio Fisso al Rimborso	0,00	1998	—	04-XI-2018	04-XI	04-XI	94.253	13.121	232.405	5000000	100,00	—
IT0001304341	BIM-IMI 1999-2024 Fixed & Zero con Premio Fisso al Rimborso	0,00	1999	—	01-II-2024	01-II	01-II	25.710	4.566	210.000	1000	100,00	—
XS1024830819	BPM 2014-2019 4,25%	4,25	2014	—	30-I-2019	30-I	30-I	500.000	5.800	500.000	100000	99,66	—
XS0472205300	Buzzi Unicem 2009-2016 5,12%	5,12	2009	—	09-XII-2016	09-XII	09-XII	350.000	2.050	350.000	50000	99,33	—
XS1401125346	Buzzi Unicem 2016-2023 2,125% Callable	2,13	2016	—	28-IV-2023	28-IV	28-IV	500.000	7.400	500.000	1000	99,40	Facoltà di rimborso anticipato in data 28-I-2023 con preavviso di almeno 30 giorni e non oltre i 60.
XS0848458179	Campari 2012-2019 4,5%	4,50	2012	—	25-X-2019	25-X	25-X	400.000	2.700	400.000	1000	99,07	—
XS1300465926	Campari 2015-2020 2,75%	2,75	2015	—	30-IX-2020	30-IX	30-IX	600.000	10.900	600.000	1000	99,72	—
IT0005068850	CDP 2014-2018 1%	1,00	2014	—	26-I-2018	26-I	26-I	750.000	1.000	750.000	1000	99,99	—
IT0004997943	CDP 2014-2019 2,375%	2,38	2014	—	12-II-2019	12-II	12-II	750.000	900	750.000	100000	99,42	—
IT0005025389	CDP 2014-2021 2,75%	2,75	2014	—	31-V-2021	31-V	31-V	750.000	2.800	750.000	1000	99,80	—
IT0005090995	CDP 2015-2022 Tasso Misto ¹⁾	1,75	2015	—	20-III-2022	20-III; 20-IX	20-III	1.500.000	517.898	1.500.000	1000	100,00	—
IT0005105488	CDP 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	09-IV-2025	09-IV	09-IV	750.000	19.400	750.000	100000	99,89	—
IT0005117095	Cdp Reti 2015-2022 1,875%	1,88	2015	—	29-V-2022	29-V	29-V	750.000	3.100	750.000	1000	99,91	—
IT0001267381	Centrobanca 1998-2018 Reverse Floater Capped	5,50	1998	—	20-X-2018	20-X	20-X	116.765	31.472	165.266	0,01	100,00	—
IT0001197083	Centrobanca 1998-2018 Zero Coupon	—	1998	—	30-I-2018	—	30-I	173.800	14.267	413.165	5000000	31,76	—
IT0001312708	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Eurostability Bond	0,00	1999	—	16-III-2019	16-III	16-III	55.250	6.605	60.000	1000	100,00	—
IT0001300992	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro a 10 Anni	0,61	1999	—	22-I-2019	22-I	22-I	116.332	35.970	170.000	1000	100,00	—
XS1088811432	CMC di Ravenna 2014-2021 7,5%	7,50	2014	—	01-VIII-2021	01-II	01-VIII	284.650	3.600	284.650	100000	100,00	—
IT0004737489	Credem 2011-2017 4,5% Amortizing	4,50	2011	—	30-VI-2017	30-III; 30-IX	30-VI	20.000	6.455	60.000	600	100,00	—
IT0004781016	Credem 2011-2017 7,05% Amortizing	7,05	2011	23-XII-2013	23-XII-2017	23-III; 23-IX	23-XII	20.000	4.218	40.000	800	100,00	—

¹⁾ Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari all'1,75%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0004870926	Credem 2012-2018 4,7% Amortizing Callable	4,70	2012	28-XII-2013	28-XII-2018	28-XII	28-XII	38.587	6.710	200.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato con preavviso di almeno 15 giorni.
IT0004803158	Credem 2012-2018 Tasso Misto Amortizing ¹⁾	0,94	2012	30-III-2013	30-III-2018	30-III; 30-IX	30-III	8.611	2.474	40.000	800	100,00	—
IT0004819006	Credem 2012-2018 Tasso Misto Amortizing ¹⁾	1,05	2012	15-VI-2013	15-VI-2018	15-III; 15-IX	15-VI	15.354	3.139	80.000	600	100,00	—
IT0001264792	Crediop 1998-2018 T.F./Capped Reverse Floater	5,50	1998	—	15-X-2018	15-X	15-X	143.442	37.166	232.405	0,01	100,00	—
IT0001277406	Crediop 1998-2018 T.F./Capped Reverse Floater	5,50	1998	—	27-XI-2018	27-XI	27-XI	57.266	11.312	61.975	0,01	100,00	—
IT0001317707	Crediop 1999-2019 Step-Down Lifestyle Accrued Interest	0,00	1999	—	29-III-2019	29-III	29-III	35.671	9.436	50.000	1000	100,00	—
IT0001303350	Crediop 1999-2019 T.F./Capped Reverse Floater	5,00	1999	—	29-I-2019	29-I	29-I	67.858	14.738	100.000	1000	100,00	—
IT0001308607	Crediop 1999-2024 Step-Down	0,00	1999	—	26-II-2024	26-II	26-II	53.695	6.227	80.000	1000	100,00	—
XS0550715600	Dexia Crediop 2010-2018 4,25% Trasformabile ²⁾	0,38	2010	—	22-X-2018	22-X	22-X	250.000	10.231	250.000	1000	100,00	—
XS0557268173	Dexia Crediop 2010-2020 Serie Speciale N.3 Reverse Floater ³⁾	5,32	2010	—	08-XI-2020	08-XI	08-XI	250.000	1.182	250.000	1000	100,00	—
IT0004650781	Dexia Crediop 2010-2020 Zero Coupon	—	2010	—	22-X-2020	—	22-X	250.000	2.710	250.000	1000	65,93	—
IT0004655533	Dexia Crediop 2010-2024 Serie Ordinaria N.4 Tasso Fisso Callable 4,5%	4,50	2010	—	08-XI-2024	08-XI	08-XI	250.000	1.312	250.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato in corrispondenza con le date di pagamento degli interessi a partire dall'8-XI-2016, con un preavviso di almeno 10 giorni.
IT0004729452	Dexia Crediop 2011-2017 5%	5,00	2011	—	07-XII-2017	07-XII	07-XII	300.000	3.540	3.000.000	1000	100,00	—
IT0005030306	E.S.T.R.A. 2014-2019 5%	5,00	2014	—	14-VII-2019	14-VII	14-VII	50.000	4.200	50.000	100000	100,00	—
XS0170343247	Enel 2003-2018 4,75%	4,75	2003	—	12-VI-2018	12-VI	12-VI	750.000	13.257	750.000	1000	99,37	—
XS0306644344	Enel 2007-2017 5,25%	5,25	2007	—	20-VI-2017	20-VI	20-VI	1.500.000	2.500	1.500.000	1000	99,58	—
XS0306646042	Enel 2007-2027 5,625%	5,63	2014	—	21-VI-2027	21-VI	21-VI	850.000	3.350	850.000	1000	99,83	—
IT0004794142	Enel 2012-2018 4,875%	4,88	2012	—	20-II-2018	20-II	20-II	2.500.000	52.377	2.500.000	1000	99,95	—
IT0004794159	Enel 2012-2018 Tasso Variabile	1,51	2012	—	20-II-2018	20-II	20-II	500.000	17.175	500.000	1000	100,00	—
XS0451457435	Eni 2009-2019 4,125%	4,13	2009	—	16-IX-2019	16-IX	16-IX	1.500.000	2.350	1.500.000	50000	99,43	—
XS0563739696	Eni 2010-2018 3,5%	3,50	2010	—	29-I-2018	29-I	29-I	1.000.000	1.900	1.000.000	1000	99,58	—

Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse pari al 4,25%. Dal 2014 eventuali cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 7%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0004760655	Eni 2011-2017 4,875%	4,88	2011	—	11-X-2017	11-X	11-X	1.109.565	19.304	1.109.565	1000	99,71	—
IT0004760648	Eni 2011-2017 Tasso Variabile	1,36	2011	—	11-X-2017	11-IV	11-X	215.011	7.644	215.011	1000	100,00	—
XS0798555537	Eni 2012-2019 3,75%	3,75	2012	—	27-VI-2019	27-VI	27-VI	750.000	600	750.000	1000	99,46	—
XS0741137029	Eni 2012-2020 4,25%	4,25	2012	—	03-II-2020	03-II	03-II	1.000.000	4.700	1.000.000	1000	99,50	—
XS0951565091	Eni 2013-2023 3,25%	3,25	2013	—	10-VII-2023	10-VII	10-VII	1.000.000	4.400	1.000.000	100000	98,81	—
XS0970852348	Eni 2013-2025 3,75%	3,75	2013	—	12-IX-2025	12-IX	12-IX	900.000	4.600	900.000	1000	99,49	—
XS1023703090	Eni 2014-2029 3,625%	3,63	2014	—	29-I-2029	29-I	29-I	1.000.000	2.600	1.000.000	1000	99,37	—
XS1292988984	Eni 2015-2024 1,75%	1,75	2015	—	18-I-2024	18-I	18-I	750.000	4.800	750.000	1000	99,19	—
XS1180451657	Eni 2015-2026 1,5%	1,50	2015	—	02-II-2026	02-II	02-II	1.000.000	35.800	1.000.000	1000	99,27	—
XS1412711217	Eni 2016-2028 1,625%	1,63	2016	—	17-V-2028	17-V	17-V	800.000	1.200	800.000	1000	98,73	—
IT0004818560	Eukedos 2012-2016 3%	3,00	2012	—	30-XI-2016	30-XI	24-XII	12.000	2.864	12.000	1,2	100,00	—
XS0300900478	Exor 2007-2017 5,375%	5,38	2007	—	12-VI-2017	12-VI	12-VI	440.000	2.050	440.000	50000	99,55	—
XS1119021357	Exor 2014-2024 2,5%	2,50	2014	—	08-X-2024	08-X	08-X	500.000	13.200	500.000	1000	99,33	—
XS1329671132	Exor 2015-2022 2,125%	2,13	2015	—	02-XII-2022	02-XII	02-XII	750.000	7.900	750.000	1000	100,00	—
IT0005104713	Ferrarini 2015-2020 6,375%	6,38	2015	—	15-IV-2020	15-IV	15-IV	30.000	4.000	30.000	100000	100,00	—
XS0954248729	Ferrovie dello Stato 2013-2022 4%	4,00	2013	—	22-VII-2022	22-VII	22-VII	750.000	1.100	750.000	1000	99,07	—
IT0005028979	FRI-EL Green Power 2014-2021 4,9%	4,90	2014	—	30-VI-2021	31-VI	30-VI	12.000	1.000	12.000	125000	100,00	—
XS0954289913	Gamenet 2013-2018 7,25%	7,50	2013	—	01-VIII-2018	01-II	01-VIII	200.000	1.100	200.000	1000	100,00	—
IT0004981913	Gpi 2013-2018 5,5%	5,50	2013	—	30-VI-2018	30-VI	30-VI	12.000	600	12.000	50000	100,00	—
XS0976307040	Hera 2013-2021 3,25%	3,25	2013	—	04-X-2021	04-X	04-X	500.000	600	500.000	1000	99,40	—
XS1084043451	Hera 2014-2024 2,375%	2,38	2014	—	04-VII-2024	04-VII	04-VII	500.000	1.300	500.000	1000	99,46	—
XS0994224672	Iccrea Banca 2013-2016 2,95%	2,95	2013	—	14-XI-2016	14-XI	14-XI	500.000	25.600	500.000	1000	99,86	—
XS0923605470	Indesit Company 2013-2018 4,5%	4,50	2013	—	26-IV-2018	26-IV	26-IV	300.000	1.300	300.000	1000	99,45	—
IT0005074577	Intek Group 2015-2020 5% Callable	5,00	2015	—	20-II-2020	20-II	20-II	101.704	43.792	101.704	21,6	100,00	Facoltà di rimborso anticipato volontario totale o parziale a partire dal 20-II-2017, con preavviso di almeno 15 giorni.
IT0001311247	Interbanca 1999-2019 Upside Protected	0,00	1999	—	01-III-2019	01-III	01-III	20.277	1.665	75.000	1000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0001304010	Interbanca 1999-2021 Coupon Reset	0,00	1999	—	16-II-2021	16-II	16-II	41.990	9.429	80.000	1000	100,00	—
XS0213927667	Intesa Sanpaolo 2005-2017 Tasso Variabile	0,11	2014	—	03-III-2017	03-III; 03-IX	03-III	364.651	2.235	364.651	1000	99,58	—
XS0555977312	Intesa Sanpaolo 2010-2018 4%	4,00	2010	—	08-XI-2018	08-XI	08-XI	1.250.000	5.100	1.250.000	100000	99,52	—
XS0452166324	Intesa Sanpaolo 2010-2019 5%	5,00	2009	—	23-IX-2019	23-IX	23-IX	1.500.000	16.200	1.500.000	50000	99,15	—
XS0500187843	Intesa Sanpaolo 2010-2020 4,125%	4,13	2010	—	14-IV-2020	14-IV	14-IV	1.250.000	4.100	1.250.000	50000	99,13	—
XS0526326334	Intesa Sanpaolo 2010-2020 5,15%	5,15	2010	—	16-VII-2020	16-VII	16-VII	1.250.000	12.600	1.250.000	50000	99,66	—
XS0852993285	Intesa Sanpaolo 2012-2017 4%	4,00	2012	—	09-XI-2017	09-XI	09-XI	1.710.906	2.000	1.710.906	1000	99,96	—
XS0750763806	Intesa Sanpaolo 2012-2017 5%	5,00	2012	—	28-II-2017	28-II	28-II	1.000.000	1.400	1.000.000	100000	99,25	—
XS0842828120	Intesa Sanpaolo 2012-2019 4,375%	4,38	2012	—	15-X-2019	15-X	15-X	1.250.000	1.700	1.250.000	100000	99,48	—
XS0986194883	Intesa Sanpaolo 2013-2023 4%	4,00	2013	—	30-X-2023	30-X	30-X	1.000.000	4.400	1.000.000	1000	99,16	—
XS0971213201	Intesa Sanpaolo 2013-2023 6,625%	6,63	2013	—	13-IX-2023	13-IX	13-IX	1.445.656	13.800	1.445.656	1000	99,12	—
XS1057822766	Intesa Sanpaolo 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,27	2014	—	17-IV-2019	17-I; 17-VII	17-IV	1.000.000	3.100	1.000.000	1000	99,76	—
XS1077772538	Intesa Sanpaolo 2014-2021 2%	2,00	2014	—	18-VI-2021	18-VI	18-VI	1.000.000	3.100	1.000.000	1000	99,69	—
XS1018032950	Intesa Sanpaolo 2014-2022 3,5%	3,50	2014	—	17-I-2022	17-I	17-I	750.000	1.300	750.000	1000	99,71	—
XS1109765005	Intesa Sanpaolo 2014-2026 3,928%	3,93	2014	—	15-IX-2026	15-IX	15-IX	1.000.000	47.700	1.000.000	1000	100,00	—
XS1168003900	Intesa Sanpaolo 2015-2020 1,125%	1,13	2015	—	14-I-2020	14-I	14-I	1.250.000	7.600	1.250.000	1000	99,45	—
XS1246144650	Intesa Sanpaolo 2015-2020 Tasso Variabile	0,26	2015	—	15-VI-2020	15-III; 15-IX	15-VI	1.000.000	5.300	1.000.000	1000	99,85	—
XS1197351577	Intesa Sanpaolo 2015-2022 1,125%	1,13	2015	—	04-III-2022	04-III	04-III	1.500.000	12.600	1.500.000	1000	99,64	—
XS1222597905	Intesa Sanpaolo 2015-2025 2,855%	2,86	2015	—	23-IV-2025	23-IV	23-IV	500.000	73.900	500.000	1000	100,00	—
XS1086104681	Iren 2014-2021 3%	3,00	2014	—	14-VII-2021	14-VII	14-VII	300.000	1.500	300.000	1000	99,23	—
XS1314238459	Iren 2015-2022 2,75%	2,75	2015	—	02-XI-2022	02-XI	02-XI	500.000	7.100	500.000	1000	99,40	—
IT0001086658	Istituto Bancario San Paolo di Torino 1997-2022 Zero Coupon	—	1997	—	30-I-2022	—	30-I	167.848	39.626	167.848	0,01	17,20	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0005107237	Landi Renzo 2015-2020 6,1% Amortizing Callable	6,10	2015	—	15-V-2020	30-VI	15-V	31.960	3.100	34.000	100000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato, con preavviso di almeno 30 giorni, in coincidenza di ciascuna cedola a partire dal VI-2018. Rimborso in rate semestrali a partire dal 30-VI-2016.
XS0182242247	Leonardo-Finmeccanica 2003-2018 5,75%	5,75	2003	—	12-XII-2018	12-XII	12-XII	500.000	6.714	500.000	1000	99,56	—
XS0215093534	Leonardo-Finmeccanica 2005-2025 4,875%	4,88	2014	—	24-III-2025	24-III	24-III	500.000	9.700	500.000	1000	99,27	—
XS0458887030	Leonardo-Finmeccanica 2009-2022 5,25%	5,25	2009	—	21-I-2022	21-I	21-I	800.000	11.350	800.000	1000	99,19	—
XS0861828407	Leonardo-Finmeccanica 2012-2017 4,375%	4,38	2012	—	05-XII-2017	05-XII	05-XII	600.000	4.500	600.000	1000	99,42	—
XS0999654873	Leonardo-Finmeccanica 2013-2021 4,5%	4,50	2013	—	19-I-2021	19-I	19-I	700.000	16.400	700.000	1000	98,51	—
IT0005123275	Ligabue 2015-2020 5,75%	5,75	2015	—	22-VII-2020	22-I	22-VII	10.000	1.000	10.000	100000	100,00	—
XS1083010311	L'Isolante K-Flex 2014-2020 6%	6,00	2014	—	01-VII-2020	01-VII	01-VII	100.000	3.500	100.000	1000	100,00	—
XS1030851791	Luxtistica Group 2014-2024 2,625%	2,63	2014	—	10-II-2024	10-II	10-II	500.000	1.300	500.000	1000	99,28	—
XS0808635352	Manutencoop Facility Management 2013-2020 8,5%	8,58	2013	—	01-VIII-2020	01-II	01-VIII	411.600	14.700	424.000	1000	98,71	—
XS0991759076	Marcolin 2013-2019 8,5%	8,50	2013	—	15-XI-2019	15-V	15-XI	188.100	8.300	188.100	1000	100,00	—
IT0001339586	Mediobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro 30 Anni	0,69	1999	—	25-VI-2019	25-VI	25-VI	44.566	10.898	75.000	1000	100,00	—
XS0556045259	Mediobanca 2010-2017 Fixed-Floating Rate ¹⁾	0,21	2010	—	07-XII-2017	07-XII	07-XII	8.357	3.774	8.357	1000	100,00	—
IT0004608797	Mediobanca 2010-2020 Primo Atto 4,5%	4,50	2010	—	14-V-2020	14-V	14-V	465.000	57.008	500.000	1000	100,00	—
IT0004645542	Mediobanca 2010-2020 Secondo Atto 5% Subordinato Lower Tier 2	5,00	2010	—	15-XI-2020	15-XI	15-XI	750.000	162.183	750.000	1000	100,00	—
IT0004743875	Mediobanca 2011-2016 3,7%	3,70	2011	—	16-VIII-2016	16-VIII	16-VIII	11.000	1.805	11.000	1000	100,00	—
XS0615801742	Mediobanca 2011-2016 4,625%	4,63	2011	—	11-X-2016	11-X	11-X	750.000	4.900	750.000	100000	99,54	—
IT0004783046	Mediobanca 2011-2017 Atto Unico Zero Coupon	—	2011	—	12-XII-2017	—	12-XII	125.000	51.287	500.000	1000	66,64	—
IT0004720436	Mediobanca 2011-2021 T.V. con Tasso Minimo e Tasso Massimo Sub. Lower Tier2	1,15	2011	—	13-VI-2021	13-III; 13-IX	13-VI	390.145	179.734	500.000	1000	100,00	—
IT0004821499	Mediobanca 2012-2016 4,45%	4,45	2012	—	13-VII-2016	13-VII	13-VII	26.466	7.639	40.171	1000	100,00	—

¹⁾ Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 2,2%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
XS0811450757	Mediobanca 2012-2016 Tasso Misto ¹⁾	2,54	2012	—	12-IX-2016	12-IX	12-IX
XS0821919171	Mediobanca 2012-2017 Indicizzato EURO STOXX 50	5,75	2012	—	16-X-2017	15-X	16-X
XS0820711132	Mediobanca 2012-2017 Inflation Linked ²⁾	1,65	2012	—	16-X-2017	16-X	16-X
IT0004839020	Mediobanca 2012-2017 Tasso Misto ³⁾	2,23	2012	—	10-VIII-2017	10-VIII	10-VIII
XS0835345082	Mediobanca 2012-2017 Tasso Misto ⁴⁾	2,16	2012	—	21-XI-2017	21-XI	21-XI
XS0783732455	Mediobanca 2012-2017 World Basket Linked ⁵⁾	2,50	2012	—	20-VI-2017	20-VI	20-VI
IT0004965577	Mediobanca 2013-2018 3,2%	3,20	2014	—	04-XII-2018	04-XII	04-XII
IT0004890361	Mediobanca 2013-2018 Fix to Floater ⁶⁾	0,27	2013	—	28-II-2018	31-II; 31-VIII	28-II
IT0004872427	Mediobanca 2013-2018 Indicizzato EURO STOXX 50	—	2013	—	16-I-2018	—	16-I
IT0004884778	Mediobanca 2013-2018 Indicizzato EURO STOXX 50	—	2013	—	26-II-2018	—	26-II
IT0004931090	Mediobanca 2013-2018 Opzione digitale EURO STOXX 50	4,00	2013	—	24-VII-2018	24-VII	24-VII
IT0004884794	Mediobanca 2013-2018 Tasso Misto ⁷⁾	1,38	2013	—	26-II-2018	26-II	26-II
IT0004909682	Mediobanca 2013-2018 Tasso Misto ⁸⁾	5,00	2013	—	18-VI-2018	18-VI	18-VI
IT0004941875	Mediobanca 2013-2019 Inflazione Italiana ⁸⁾	2,20	2013	—	11-I-2019	11-I	11-I
IT0004965585	Mediobanca 2013-2019 Opzioni digitali EURO STOXX 50 ⁸⁾	0,88	2014	—	04-XII-2019	04-III; 04-IX	04-XII
IT0004872435	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto ⁹⁾	1,95	2013	—	16-I-2019	16-I	16-I
IT0004892425	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto	1,26	2013	—	02-IV-2019	02-IV	02-IV
IT0004899511	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto ¹⁰⁾	1,14	2013	—	17-V-2019	17-V	17-V
IT0004921646	Mediobanca 2013-2020 Tasso Variabile Cap and Floor	0,76	2013	—	18-VI-2020	18-III; 18-IX	18-VI
IT0004931082	Mediobanca 2013-2020 Tasso Variabile Cap&Floor	0,76	2013	—	24-VII-2023	24-I; 24-VII	24-VII

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
5.091	1.931	10.608	1000	100,00	—
7.667	588	7.667	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
14.200	1.903	14.200	1000	100,00	—
12.415	4.984	22.064	1000	100,00	—
26.126	9.846	48.363	1000	100,00	—
12.980	992	15.000	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
20.830	4.168	29.889	1000	100,00	—
6.761	3.416	6.761	1000	100,00	—
5.444	676	5.444	1000	100,00	—
8.025	1.127	8.025	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
7.576	1.502	7.576	1000	100,00	—
33.004	10.942	36.159	1000	100,00	—
26.390	9.391	26.390	1000	100,00	—
50.000	7.047	200.000	1000	99,50	—
4.997	886	4.997	1000	100,00	—
34.261	15.125	50.368	1000	100,00	—
40.039	24.680	40.039	1000	100,00	—
25.439	11.453	25.439	1000	100,00	—
12.918	2.360	19.006	1000	100,00	—
26.655	8.309	30.531	1000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 2,5%. Successivamente cedole nulle. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 8) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 3,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 9) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4,3%. Successivamente cedole indicizzate. - 10) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 3,4%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0004936149	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50 ¹⁾	4,00	2013	—	29-VIII-2021	29-VIII	29-VIII	23.224	3.419	23.224	1000	100,00	—
IT0004952401	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50 ²⁾	4,00	2013	—	25-IX-2021	25-IX	25-IX	9.600	2.983	9.600	1000	100,00	—
IT0004958069	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50 ³⁾	4,00	2013	—	30-X-2021	30-X	30-X	11.300	4.378	11.300	1000	100,00	—
IT0004924004	Mediobanca 2013-2021 Sintesi Tasso Misto ⁴⁾	6,00	2013	—	21-XI-2021	21-V	21-XI	23.000	4.706	40.000	1000	100,00	—
IT0004924046	Mediobanca 2013-2021 Sintesi Tasso Misto USD ⁵⁾	6,50	2013	—	21-XI-2021	21-V	21-XI	USD 14.000	USD 2.234	USD 20.000	USD 1.000	100,00	—
IT0004917842	Mediobanca 2013-2023 5,75%	5,75	2013	—	18-IV-2023	18-IV	18-IV	496.563	196.163	500.000	1000	100,00	—
IT0004958051	Mediobanca 2013-2023 Tasso Misto con Cap&Floor ⁶⁾	0,76	2013	—	30-X-2023	30-I; 30-VII	30-X	64.964	23.852	77.975	1000	100,00	—
IT0004967201	Mediobanca 2013-2023 Tasso Misto con Cap&Floor ²⁾	0,75	2014	—	04-XII-2023	04-III; 04-IX	04-XII	45.767	12.830	52.337	1000	100,00	—
IT0004952336	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile Cap&Floor	0,76	2013	—	25-IX-2023	25-III; 25-IX	25-IX	8.751	2.439	11.214	1000	100,00	—
IT0004935976	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile con Cap&Floor	0,76	2013	—	29-VIII-2023	29-II; 29-VIII	29-VIII	17.960	5.246	21.311	1000	100,00	—
XS1137512312	Mediobanca 2014-2017 0,875%	0,88	2014	—	14-XI-2017	14-XI	14-XI	1.250.000	2.100	1.250.000	1000	99,97	—
XS1046272420	Mediobanca 2014-2019 2,25%	2,25	2014	—	18-III-2019	18-III	18-III	750.000	2.100	750.000	1000	99,89	—
IT0005056483	Mediobanca 2014-2019 3% USD	3,00	2014	—	02-X-2019	02-X	02-X	USD 400.000	USD 182.928	USD 400.000	USD 2.000	100,00	—
XS0993892909	Mediobanca 2014-2021 Fixed to Floating with Cap&Floor ⁷⁾	0,57	2014	—	22-I-2021	22-I; 22-VII	22-I	8.110	2.474	8.110	1000	100,00	—
IT0005013054	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50 ⁸⁾	—	2014	—	28-V-2021	28-V	28-V	9.099	2.047	9.099	1000	100,00	—
IT0005021602	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50 ⁸⁾	3,00	2014	—	30-VI-2021	30-VI	30-VI	8.816	1.174	8.816	1000	100,00	—
IT0005026999	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	3,65	2014	—	13-VIII-2021	13-VIII	13-VIII	6.220	1.062	6.220	1000	100,00	—
IT0005044711	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	—	2014	—	15-X-2021	15-X	15-X	5.911	793	5.911	1000	100,00	—
IT0005021586	Mediobanca 2014-2021 Tasso Misto con Cap ⁹⁾	0,63	2014	—	30-VI-2021	30-III; 30-IX	30-VI	8.528	6.319	8.528	1000	100,00	—
IT0004981871	Mediobanca 2014-2022 3,2%	3,20	2014	—	26-II-2022	26-II	26-II	42.183	11.724	48.756	1000	100,00	—
XS0993892735	Mediobanca 2014-2022 3,2%	3,20	2014	—	22-I-2022	22-I	22-I	38.042	10.727	46.371	1000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4 e 4,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento pari al 4% per il primo anno e al 4,5% per il secondo anno. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 8) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 9) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 2,5%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
IT0004998172	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto ¹⁾	0,32	2014	—	02-IV-2022	02-I; 02-VII	02-IV
IT0005004475	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto ¹⁾	0,29	2014	—	19-V-2022	19-II; 19-VIII	19-V
IT0004981889	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto con Cap e Floor ²⁾	0,64	2014	—	26-II-2022	26-II; 26-VIII	26-II
IT0005091894	Mediobanca 2015-2020 2,25% USD	2,25	2015	—	06-V-2020	06-V	06-V
IT0005092330	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile Cap and Floor USD	0,39	2015	—	06-V-2020	06-II; 06-VIII	06-V
IT0005143257	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile GBP	0,50	2015	—	12-XI-2020	12-II; 12-VIII	12-XI
IT0005143240	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile USD	0,52	2015	—	12-XI-2020	12-II; 12-VIII	12-XI
IT0005122830	Mediobanca 2015-2022 Opzioni digitali ³⁾	1,80	2015	—	16-IX-2022	16-IX	16-IX
IT0005118796	Mediobanca 2015-2025 2,75% Callabile	2,75	2015	—	12-VI-2025	12-VI	12-VI
IT0005127508	Mediobanca 2015-2025 Valore	0,78	2015	—	10-IX-2025	10-III; 10-IX	10-IX
XS1346762641	Mediobanca 2016-2021 1,625%	1,63	2016	—	19-I-2021	19-I	19-I
IT0001278404	Mediocredito Centrale 1998-2018 Floored Top Side	0,38	1998	—	03-XII-2018	03-III; 03-IX	03-XII
IT0001287249	Mediocredito Centrale 1998-2018 Step-Down	0,00	1998	—	24-XII-2018	24-XII	24-XII
IT0001203253	Mediocredito Centrale 1998-2028 Zero Coupon	—	1998	—	10-II-2028	—	10-II
IT0001306171	Mediocredito Centrale 1999-2019 Step-Down Zero Coupon	—	1999	—	18-II-2019	18-II	18-II
IT0001271649	Mediocredito Lombardo 1998-2018 Reverse Floater Capped	5,50	1998	—	06-XI-2018	06-XI	06-XI
IT0001205589	Mediocredito Lombardo 1998-2028 Zero Coupon	—	1998	—	18-II-2028	—	18-II
IT0001292850	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	0,61	1999	—	15-I-2019	15-I	15-I
IT0001336368	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	0,37	1999	—	03-VI-2019	03-VI	03-VI

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
8.416	4.105	8.416	1000	100,00	—
10.251	5.703	10.251	1000	100,00	—
12.588	3.073	12.588	1000	100,00	—
USD 15.344	USD 10.656	USD 15.344	USD 2.000	100,00	—
USD 12.516	USD 6.052	USD 12.516	USD 2.000	100,00	—
GBP 70.000	GBP 10.894	GBP 70.000	GBP 2.000	100,00	—
USD 100.000	USD 27.804	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
13.858	1.652	13.858	1000	100,00	—
200.000	129.567	200.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato il 12-VI-2020, con preavviso di almeno 8 giorni, per un importo del 100% del valore nominale.
500.000	990.646	500.000	1000	100,00	—
600.000	800	600.000	1000	99,88	—
42.105	9.562	51.646	0,01	100,00	—
42.982	8.693	77.468	0,01	100,00	—
256.356	43.412	309.874	0,01	17,52	—
98.396	13.115	120.000	1000	100,00	—
246.653	37.712	284.051	0,01	100,00	—
201.147	47.556	206.582	0,01	17,37	—
191.106	72.320	300.000	1000	100,00	—
70.000	20.838	70.000	1000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 2,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari all'1,8%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0001307286	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down Reverse Floater Capped	5,00	1999	—	18-II-2019	18-II	18-II	207.654	38.071	207.654	1000	100,00	—
IT0005105900	Micoperi 2015-2020 5,75%	5,75	2015	—	29-IV-2020	29-I; 29-VII	29-IV	35.000	4.300	35.000	100000	100,00	—
IT0004936289	Mittel 2013-2019 6% Callable	6,00	2013	—	12-VII-2019	12-I	12-VII	99.854	27.026	99.854	1,75	98,50	Facoltà di rimborso anticipato parziale nel VII-2017 e VII-2018, con preavviso di almeno 30 giorni, per un importo del 25% o del 50% del valore nominale. L'emittente è tenuto, per tutta la durata del prestito, al rispetto di determinati obblighi in materia di limiti all'assunzione di ulteriore indebitamento, negative pledge e limiti alla distruzione di dividendi e riserve da utili. In caso di inadempimento l'emittente sarà tenuto al rimborso anticipato obbligatorio, alla pari, delle obbligazioni.
XS1074596344	Officine Maccaferri 2014-2021 5,75%	5,75	2014	—	01-VI-2021	01-VI	01-VI	187.500	7.400	197.500	1000	100,00	—
XS1214547777	Prysmian 2015-2022 2,5%	2,50	2015	—	11-IV-2022	11-IV	11-IV	750.000	53.700	750.000	1000	99,00	—
XS1237519571	RAI 2015-2020 1,5%	1,50	2015	—	28-V-2020	28-V	28-V	350.000	3.100	350.000	1000	99,27	—
XS0956262892	Salini Impregilo 2013-2018 6,125%	6,13	2013	—	01-VIII-2018	01-VIII	01-VIII	400.000	17.500	400.000	1000	99,48	—
IT0001302659	Sanpaolo IMI 1999-2019 Indicizzato Swap Euro 10 Anni Floor 3,25%	3,25	1999	—	25-I-2019	25-I	25-I	150.000	19.289	150.000	1000	100,00	—
IT0005054173	Sipcam 2014-2019 6,5%	6,50	2014	—	30-IX-2019	30-III; 30-IX	30-IX	15.000	1.300	15.000	100000	100,00	—
XS0931919947	Sisal Holding 2013-2017 7,25%	7,25	2013	—	30-IX-2017	30-III	30-IX	271.335	9.900	271.335	1000	100,00	—
XS0803479442	Snam 2012-2016 4,375%	4,38	2012	—	11-VII-2016	11-VII	11-VII	1.000.000	800	1.000.000	1000	99,83	—
XS0806449814	Snam 2012-2019 5%	5,00	2012	—	18-I-2019	18-I	18-I	1.000.000	5.600	1.000.000	1000	99,85	—
XS0853682069	Snam 2012-2020 3,5%	3,50	2012	—	13-II-2020	13-II	13-II	750.000	4.500	750.000	1000	99,65	—
XS0829190585	Snam 2012-2022 5,25%	5,25	2012	—	19-IX-2022	19-IX	19-IX	1.000.000	2.900	1.000.000	1000	99,44	—
XS0914292254	Snam 2013-2017 2,375%	2,38	2013	—	30-VI-2017	30-VI	30-VI	1.000.000	700	1.000.000	100000	99,72	—
XS0914294979	Snam 2013-2021 3,375%	3,38	2013	—	29-I-2021	29-I	29-I	500.000	1.300	500.000	100000	99,69	—
XS1126183760	Snam 2014-2023 1,5%	1,50	2014	—	21-IV-2023	21-IV	21-IV	500.000	2.900	500.000	1000	99,29	—
XS1019326641	Snam 2014-2024 3,25%	3,25	2014	—	22-I-2024	22-I	22-I	600.000	2.200	600.000	1000	99,02	—
XS1318709497	Snam 2015-2023 1,375%	1,38	2015	—	19-XI-2023	19-XI	19-XI	750.000	1.100	750.000	1000	99,19	—
IT0005058372	TBS Group 2014-2019 6,5%	6,50	2014	—	31-X-2019	31-I; 31-VII	31-X	15.000	700	15.000	100000	100,00	—
XS0184373925	Telecom Italia 2004-2019 5,375%	5,38	2004	—	29-I-2019	29-I	29-I	1.250.000	5.400	1.250.000	100000	99,07	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS0214965963	Telecom Italia 2005-2055 5,25%	5,25	2014	—	17-III-2055	17-III	17-III	670.000	53.900	670.000	100000	99,67	—
XS0486101024	Telecom Italia 2010-2022 5,25%	5,25	2010	—	10-II-2022	10-II	10-II	1.250.000	18.600	1.250.000	50000	99,30	—
XS0693940511	Telecom Italia 2011-2017 7%	7,00	2011	—	20-I-2017	20-I	20-I	750.000	4.300	750.000	1000	99,41	—
XS0630463965	Telecom Italia 2011-2018 4,75%	4,75	2011	—	25-V-2018	25-V	25-V	750.000	3.600	750.000	1000	99,89	—
XS0831389985	Telecom Italia 2012-2017 4,5%	4,50	2012	—	20-IX-2017	20-IX	20-IX	1.000.000	4.700	1.000.000	1000	99,69	—
XS0794393396	Telecom Italia 2012-2018 6,125%	6,13	2012	—	14-XII-2018	14-XII	14-XII	750.000	2.400	750.000	1000	99,74	—
XS0868458653	Telecom Italia 2012-2020 4%	4,00	2012	—	21-I-2020	21-I	21-I	1.000.000	7.200	1.000.000	1000	99,18	—
XS0974375130	Telecom Italia 2013-2020 4,875%	4,88	2013	—	25-IX-2020	25-IX	25-IX	1.000.000	5.800	1.000.000	1000	98,97	—
XS1020952435	Telecom Italia 2014-2021 4,5%	4,50	2014	—	25-I-2021	25-I	25-I	1.000.000	5.700	1.000.000	1000	99,45	—
XS1169832810	Telecom Italia 2015-2023 3,25%	3,25	2015	—	16-I-2023	16-I	16-I	1.000.000	42.000	1.000.000	1000	99,45	—
XS1347748607	Telecom Italia 2016-2024 3,625%	3,63	2016	—	19-I-2024	19-I	19-I	750.000	48.900	750.000	1000	99,63	—
XS1419869885	Telecom Italia 2016-2026 3,625%	3,63	2016	—	25-V-2026	25-V	25-V	1.000.000	8.700	1.000.000	1000	100,00	—
XS0605214336	Terna 2011-2021 4,75%	4,75	2011	—	15-III-2021	15-III	15-III	1.250.000	850	1.250.000	1000	99,25	—
XS0843310748	Terna 2012-2018 2,875%	2,88	2012	—	16-II-2018	16-II	16-II	USD 750.000	USD 900	USD 750.000	USD 1.000	99,74	—
IT0004991573	TerniEnergia 2014-2019 6,875%	6,88	2014	—	06-II-2019	06-II	06-II	25.000	3.700	25.000	50000	100,00	—
IT0005012247	Tesmec 2014-2021 6%	6,00	2014	—	10-IV-2021	10-IV	10-IV	15.000	3.400	15.000	100000	100,00	—
IT0005009524	TIP 2014-2020 4,75%	4,75	2014	—	14-IV-2020	14-IV	14-IV	100.000	46.076	100.000	1000	100,00	—
IT0005038382	Trevi Finanziaria Industriale 2014-2019 5,25%	5,25	2014	—	28-VII-2019	28-VII	28-VII	50.000	9.200	50.000	100000	100,00	—
XS1086778641	Twin Set - Simona Barbieri 2014-2019 Tasso Variabile	1,41	2014	—	15-VII-2019	15-I; 15-VII	15-VII	150.000	1.800	150.000	1000	99,00	—
IT0004457070	UBI Banca 2009-2019 Fixed to Euribor Linked	0,86	2009	—	13-III-2019	13-III	13-III	370.000	122.000	370.000	1000	100,00	—
IT0004497050	UBI Banca 2009-2019 Fixed-Floater	1,81	2009	—	30-VI-2019	30-VI	30-VI	365.000	95.886	365.000	1000	100,00	—
IT0004572878	UBI Banca 2010-2017 3,1%	3,10	2010	—	23-II-2017	23-II	23-II	60.000	19.528	300.000	1000	100,00	Rimborso in rate annuali a partire dal 23-II-2013.
IT0004572860	UBI Banca 2010-2017 Sub Lower Tier II	0,70	2010	—	23-II-2017	23-II	23-II	30.517	21.814	300.000	1000	100,00	—
IT0004723489	UBI Banca 2011-2018 5,4% Amortizing	5,40	2011	—	30-VI-2018	30-VI	30-VI	160.000	62.819	400.000	1000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0004718489	UBI Banca 2011-2018 5,5% Amortizing	5,50	2011	—	16-VI-2018	16-VI	16-VI	160.000	49.797	400.000	1000	100,00	—
IT0004767742	UBI Banca 2011-2018 Subordinato Lower Tier II - Tasso Misto Welcome Edition ¹⁾	0,74	2011	—	18-XI-2018	18-II; 18-VIII	18-XI	222.339	68.396	222.339	1000	100,00	—
IT0004851728	UBI Banca 2012-2016 Step Up 4% ²⁾	5,50	2012	—	19-X-2016	19-IV	19-X	20.000	2.683	20.000	1000	100,00	—
IT0004851710	UBI Banca 2012-2016 Welcome Edition CGM ³⁾	0,69	2012	—	23-XI-2016	23-II; 23-VIII	23-XI	17.552	2.492	17.552	1000	100,00	—
IT0004842370	UBI Banca 2012-2019 6% Amortizing	6,00	2012	08-X-2015	08-X-2019	08-IV	08-X	776.366	192.009	970.457	1000	100,00	—
IT0004841778	UBI Banca 2012-2019 Tasso Misto Welcome Edition ⁴⁾	4,76	2012	—	08-X-2019	08-I; 08-VII	08-X	200.000	63.817	200.000	1000	100,00	—
IT0004874985	UBI Banca 2013-2017 Step Up 3% ⁵⁾	4,00	2013	—	31-I-2017	31-I	31-I	157.532	15.819	157.532	1000	100,00	—
XS1033018158	UBI Banca 2014-2019 2,875%	2,88	2014	—	18-II-2019	18-II	18-II	1.000.000	1.700	1.000.000	1000	99,88	—
XS1404902535	UBI Banca 2016-2026 Tasso Misto Callable	4,25	2016	—	05-V-2026	05-V	05-V	750.000	700	750.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato il 5-V-2021, con preavviso fra i 15 e i 30 giorni, per un importo del 100% del valore nominale.
XS1041042828	UGF 2014-2021 4,375%	4,38	2014	—	05-III-2021	05-III	05-III	500.000	3.500	500.000	1000	99,37	—
XS1206977495	UGF 2015-2025 3%	3,00	2015	—	18-III-2025	18-III	18-III	1.000.000	85.700	1.000.000	1000	99,88	—
XS0322918565	UniCredit 2007-2017 5,75%	5,75	2014	—	26-IX-2017	26-IX	26-IX	1.000.000	3.100	1.000.000	1000	99,59	—
XS0367777884	UniCredit 2008-2018 6,7%	6,70	2014	—	05-VI-2018	05-VI	05-VI	835.303	4.050	835.303	1000	99,82	—
XS0618847775	UniCredit 2011-2021 6,125%	6,13	2011	—	19-IV-2021	19-IV	19-IV	750.000	27.900	750.000	1000	99,62	—
XS0863482336	UniCredit 2012-2018 3,375%	3,38	2012	—	11-I-2018	11-I	11-I	750.000	800	750.000	1000	99,69	—
IT0004825029	UniCredit 2012-2018 5,65%	5,65	2012	—	24-VIII-2018	24-VIII	24-VIII	547.108	25.899	547.108	1000	100,00	—
IT0004808421	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 5%	5,00	2012	—	21-V-2018	21-V	21-V	399.840	19.820	399.840	1000	100,00	—
IT0004787476	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 6,1%	6,10	2012	—	16-III-2018	16-III	16-III	249.990	16.596	249.990	1000	100,00	—
XS0849517650	UniCredit 2012-2022 6,95%	6,95	2012	—	31-X-2022	31-X	31-X	1.250.000	48.200	1.250.000	1000	99,92	—
XS0973623514	UniCredit 2013-2019 3,625%	3,63	2013	—	24-I-2019	24-I	24-I	1.250.000	1.100	1.250.000	1000	99,61	—
XS1055725730	UniCredit 2014-2017 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,32	2014	—	10-IV-2017	10-I; 10-VII	10-IV	1.250.000	700	1.250.000	1000	99,91	—
XS1078760813	UniCredit 2014-2019 1,5%	1,50	2014	—	19-VI-2019	19-VI	19-VI	1.000.000	3.200	1.000.000	1000	99,50	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 6,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse a crescere pari al 4%, 4,2%, 4,7% e 5,5% annuo. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 7,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse a crescere pari al 3%, 3,25%, 3,75% e 4% annuo.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
IT0005022055	Unicredit 2014-2020 2,1% OneStep BancoPosta ¹⁾	2,10	2014	—	31-VII-2020	31-VII	31-VII
XS1014627571	UniCredit 2014-2021 3,25%	3,25	2014	—	14-I-2021	14-I	14-I
XS1169707087	UniCredit 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,27	2015	—	19-II-2020	19-II; 19-VIII	19-II
XS1374865555	Unicredit 2016-2023 2%	2,00	2016	—	04-III-2023	04-III	04-III
XS1426039696	UniCredit 2016-2027 Tasso Misto Callable	4,38	2016	—	03-I-2027	03-I	03-I
XS1377799355	Unicredit Bank 2016-2026 Premiere Bond Fixed to Floater GBP ²⁾	0,78	2016	—	11-IV-2026	11-I; 11-VII	11-IV
XS1377769879	Unicredit Bank 2016-2026 Premiere Bond Fixed to Floater USD ²⁾	1,05	2016	—	11-IV-2026	11-I; 11-VII	11-IV
XS0472940617	Unipol 2009-2017 5%	5,00	2009	—	11-I-2017	11-I	11-I
XS1016053537	Veneto Banca 2014-2017 4%	4,00	2014	—	20-I-2017	20-I	20-I
XS1069508494	Veneto Banca 2014-2019 4%	4,00	2014	—	20-V-2019	20-V	20-V
XS1139056037	Waste Italia 2014-2019 10,5%	10,50	2014	—	15-XI-2019	15-V	15-XI
DI SOCIETÀ ESTERE							
XS1166160173	Abbey 2015-2022 1,12%	1,12	2015	—	14-I-2022	14-I	14-I
NL0009061357	ABN AMRO Bank 2009-2016 4,3%	4,34	2009	—	08-X-2016	08-I 08-VII	08-X
NL0009287614	ABN AMRO Bank 2009-2019 4,6%	4,60	2009	—	11-XII-2019	11-III 11-XII; 11-IX	11-IX
NL0009054907	ABN AMRO Bank 2009-2019 5,5%	5,50	2009	—	20-IV-2019	20-IV	20-IV
NL0009062215	ABN AMRO Bank 2009-2019 Royal Fisso-Variabile ³⁾	0,50	2009	—	08-X-2019	08-I; 08-VII	08-X
NL0009289339	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal 5,5% Inflazione	1,64	2010	—	11-I-2020	11-I	11-I
NL0009289313	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal Euribor	2,06	2010	—	11-I-2020	11-I; 11-VII	11-I

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
50.000	9.380	50.000	10000	100,00	—
1.250.000	5.200	1.250.000	1000	99,43	—
1.000.000	13.700	1.000.000	1000	99,75	—
1.000.000	2.100	1.000.000	1000	99,22	—
750.000	1.700	750.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato il 3-I-2022, con preavviso fra i 15 e i 30 giorni, per un importo del 100% del valore nominale.
GBP 6.000	GBP 8.312	GBP 50.000	GBP 1.000	100,00	—
USD 47.000	USD 50.767	USD 100.000	USD 1.000	100,00	—
750.000	12.900	750.000	1000	99,31	—
350.000	49.200	350.000	1000	99,65	—
500.000	82.900	500.000	1000	99,56	—
129.875	600	129.875	1000	92,29	—
1.500.000	700	1.500.000	1000	99,87	—
192.778	15.242	250.000	1000	100,00	—
67.962	6.297	100.000	1000	100,00	—
151.691	11.861	400.000	1000	100,00	—
209.298	38.730	500.000	1000	100,00	—
46.664	7.257	175.000	1000	100,00	—
83.683	12.621	300.000	1000	100,00	—

1) Cedole fisse pari al 3,3% annuo la prima cedola e 2,1% annuo le restanti cedole. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al IV-2020 pari al 3,10%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole in pagamento fino al 2019 pari al 6%. Facoltà per l'emittente di trasformare il prestito in tasso variabile con cedola trimestrale.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1114159277	Adidas 2014-2026 2,25%	2,25	2014	—	08-X-2026	08-X	08-X	400.000	1.638	400.000	1000	99,36	—
FR0010814459	Air France-KLM 2009-2016 6,75%	6,75	2009	—	27-X-2016	27-X	27-X	700.000	1.100	700.000	50000	99,32	—
FR0011965177	Air France-KLM 2014-2021 3,875%	3,88	2014	—	18-VI-2021	18-VI	18-VI	600.000	35.000	600.000	100000	99,25	—
XS0995040051	Anglo American Capital 2013-2020 2,875%	2,88	2013	—	20-XI-2020	20-XI	20-XI	600.000	700	600.000	1000	99,40	—
XS1052677892	Anglo American Capital 2014-2023 3,25%	3,25	2014	—	03-IV-2023	03-IV	03-IV	750.000	800	750.000	1000	99,82	—
BE6276040431	Anheuser-Busch 2015-2030 1,5%	1,50	2015	—	18-IV-2030	18-IV	18-IV	1.250.000	882	1.250.000	1000	99,14	—
XS1048518358	ArcelorMittal 2014-2019 3%	3,00	2014	—	25-III-2019	25-III	25-III	750.000	4.000	750.000	1000	99,65	—
XS1084568762	ArcelorMittal 2014-2020 2,87%	2,87	2014	—	06-VII-2020	06-VII	06-VII	600.000	7.200	600.000	1000	99,18	—
XS1214673565	ArcelorMittal 2015-2018 Tasso Variabile	0,51	2015	—	09-IV-2018	09-I; 09-VII	09-IV	400.000	3.000	400.000	1000	100,00	—
XS1214673722	ArcelorMittal 2015-2021 3%	3,00	2015	—	09-IV-2021	09-IV	09-IV	500.000	14.900	500.000	1000	99,55	—
XS1167308128	ArcelorMittal 2015-2022 3,125%	3,13	2015	—	14-I-2022	14-I	14-I	750.000	16.500	750.000	1000	99,73	—
FR0011560986	Areva 2013-2020 3,25%	3,25	2013	—	04-IX-2020	04-IX	04-IX	500.000	4.100	500.000	100000	99,29	—
XS0625841142	Bank of America 2011-2018 TV Floored Capped Invest Bond	1,00	2011	—	10-V-2018	10-II; 10-VIII	10-V	19.338	2.494	40.000	1000	100,00	—
XS0584356942	Bank of America 2011-2026 5,25% Callable	5,25	2011	—	31-I-2026	31-I	31-I	100.000	5.478	100.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato in corrispondenza con le date di pagamento degli interessi a partire dal 31-I-2021, con un preavviso di almeno 5 giorni.
IT0006709056	Barclays Bank 2009-2016 Obbligazioni con Cap	0,46	2009	—	15-XII-2016	15-XII	15-XII	20.540	4.060	30.000	1000	100,00	—
IT0006703208	Barclays Bank 2009-2019 6%	6,00	2009	—	21-VII-2019	21-VII	21-VII	53.021	6.062	200.000	1000	100,00	—
IT0006708413	Barclays Bank 2009-2019 Floating Rate Notes USD	1,22	2009	—	12-X-2019	12-IV	12-X	USD 6.639	USD 2.130	USD 25.000	USD 1.000	100,00	—
IT0006706326	Barclays Bank 2009-2019 Inflation Floored Notes ¹⁾	3,00	2009	—	06-X-2019	06-X	06-X	41.900	5.085	200.000	1000	100,00	—
IT0006706318	Barclays Bank 2009-2019 Zero Coupon Notes	—	2009	—	06-X-2019	—	06-X	11.585	3.197	20.000	1000	67,00	—
IT0006715483	Barclays Bank 2010-2017 Fixed Floater Notes ²⁾	0,21	2010	—	30-VI-2017	30-III; 30-IX	30-VI	225.112	29.029	305.956	1000	100,00	—
IT0006712951	Barclays Bank 2010-2020 Fixed Floating Rate Notes ³⁾	0,47	2010	—	02-III-2020	02-III	02-III	19.493	3.846	100.000	1000	100,00	—

1) Cedole in pagamento fino al 2011 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 2%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Prime due cedole fisse pari al 7%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
IT0006715426	Barclays Bank 2010-2022 4,6%	4,60	2010	—	16-VI-2022	16-VI	16-VI	8.421	813	100.000	1000	100,00	—
IT0006715392	Barclays Bank 2010-2025 10,5% Inverse Floater Floored Notes ¹⁾	9,32	2010	—	16-VI-2025	16-VI	16-VI	6.381	1.191	100.000	1000	100,00	—
IT0006715418	Barclays Bank 2010-2025 6% Inverse Floater Floored Notes ²⁾	6,16	2010	—	16-VI-2025	16-VI	16-VI	5.097	753	100.000	1000	100,00	—
IT0006710880	Barclays Bank 2010-2025 Inflation Floored Notes	3,00	2010	—	07-I-2025	07-I	07-I	11.662	2.190	108.200	1000	100,00	—
IT0006712142	Barclays Bank 2010-2025 Scudo 7,5%	1,94	2010	—	29-I-2025	29-I; 29-VII	29-I	17.193	2.019	200.000	1000	100,00	—
XS1116480697	Barclays Bank 2014-2022 1,5%	1,50	2014	—	01-IV-2022	01-IV	01-IV	1.000.000	800	1.000.000	1000	99,53	—
XS1075218799	Barclays Bank 2014-2024 2,25%	2,25	2014	—	10-VI-2024	10-VI	10-VI	1.000.000	600	1.000.000	1000	99,13	—
IT0006729377	Barclays Bank 2014-2024 2,8%	2,80	2014	—	20-VI-2024	20-VI	20-VI	500.000	600	500.000	200000	100,00	—
XS0653885961	BMW Finance 2011-2018 3,625%	3,63	2011	—	29-I-2018	29-I	29-I	1.000.000	2.675	1.000.000	1000	99,73	—
XS1052683353	BMW Finance 2014-2017 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,09	2014	—	04-IV-2017	04-I; 04-VII	04-IV	1.000.000	520	1.000.000	1000	100,00	—
XS1105264821	BMW Finance 2014-2018 0,5%	0,50	2014	—	05-IX-2018	05-IX	05-IX	750.000	552	750.000	1000	99,45	—
XS1105276759	BMW Finance 2014-2022 1,25%	1,25	2014	—	05-IX-2022	05-IX	05-IX	750.000	975	750.000	1000	99,63	—
XS1015217703	BMW Finance 2014-2024 2,625%	2,63	2014	—	17-I-2024	17-I	17-I	750.000	755	750.000	1000	99,24	—
XS1168971213	BMW Finance 2015-2020 0,5%	0,50	2015	—	21-I-2020	21-I	21-I	750.000	4.088	750.000	1000	99,98	—
XS1168962063	BMW Finance 2015-2025 1%	1,00	2015	—	21-I-2025	21-I	21-I	750.000	1.696	750.000	1000	99,21	—
DE000A1Z6M12	BMW US Capital 2015-2021 1,125%	1,13	2015	—	18-IX-2021	18-IX	18-IX	1.000.000	688	1.000.000	1000	99,69	—
DE000A1ZZ010	BMW US Capital 2015-2022 0,625%	0,63	2015	—	20-IV-2022	20-IV	20-IV	1.000.000	765	1.000.000	1000	99,48	—
DE000A1ZZ028	BMW US Capital 2015-2027 1%	1,00	2015	—	20-IV-2027	20-IV	20-IV	500.000	3.712	500.000	1000	98,66	—
XS1235187306	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto AUD ³⁾	6,00	2015	—	03-VI-2023	03-III; 03-IX	03-VI	AUD 60.000	AUD 50.402	AUD 60.000	AUD 2.000	100,00	—
XS1235201735	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto NZD ³⁾	6,00	2015	—	03-VI-2023	03-III; 03-IX	03-VI	NZD 45.000	NZD 39.066	NZD 50.000	NZD 2.000	100,00	—
XS1218967377	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto USD ⁴⁾	1,00	2015	—	27-IV-2023	27-I; 27-VII	27-IV	USD 107.000	USD 81.996	USD 125.000	USD 2.000	100,00	—
XS1190632999	BNP Paribas 2015-2025 2,375%	2,38	2015	—	17-II-2025	17-II	17-II	1.500.000	3.700	1.500.000	1000	99,64	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 10,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
IT0006731068	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2014-2017 10% BRL	10,00	2014	—	02-XII-2017	02-XII	02-XII
IT0006731605	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2020 4,5% MXN	4,50	2015	—	02-II-2020	02-II	02-II
IT0006731613	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2020 8% TRY	8,00	2015	—	02-II-2020	02-II	02-II
XS1319787153	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2023 Inverse Floater USD ¹⁾	2,75	2015	—	25-XI-2023	25-V	25-XI
XS1257901600	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2023 Tasso Misto ²⁾	1,00	2015	—	22-VII-2023	22-I; 22-VII	22-VII
XS1289967298	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2025 Tasso Misto USD ³⁾	5,00	2015	—	22-IX-2022	22-III; 22-IX	22-IX
IT0006734344	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2019 11% BRL	11,00	2016	—	12-IV-2019	12-IV	12-IV
XS1365096087	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 2,70% USD Callable	2,70	2016	—	02-III-2026	02-III	02-III
XS1365095865	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 3,75% AUD	3,75	2016	—	02-III-2026	02-III	02-III
XS1408405725	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 Misto Misto USD ⁴⁾	1,38	2016	—	25-V-2026	25-II; 25-VIII	25-V
XS1385360505	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 Tasso Misto	5,00	2016	—	12-IV-2026	12-I; 12-VII	12-IV
XS1040506112	BP Capital Markets 2014-2021 2,177%	2,18	2014	—	28-IX-2021	28-IX	28-IX
XS1114473579	BP Capital Markets 2014-2026 2,21%	2,21	2014	—	25-IX-2026	25-IX	25-IX
XS1190973559	BP Capital Markets 2015-2023 1,109%	1,11	2015	—	16-II-2023	16-II	16-II
XS1190974011	BP Capital Markets 2015-2027 1,573%	1,57	2015	—	16-II-2027	16-II	16-II
XS1109741246	British Sky Broadcasting Group 2014-2021 1,5%	1,50	2014	—	15-IX-2021	15-IX	15-IX
FR0011765825	Casino Guichard Perrachon 2014-2024 4,498%	3,25	2014	—	07-III-2024	07-III	07-III
FR0012074284	Casino Guichard-Perrachon 2014-2026 4,048%	2,80	2014	—	05-VIII-2026	05-VIII	05-VIII
XS1190302775	Citigroup 2015-2022 Fixed to Capped and Floored Floating Rate Notes ⁵⁾	0,33	2015	—	18-II-2022	18-II; 18-VIII	18-II

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
BRL 105.000	BRL 67.310	BRL 125.000	BRL 1.000	100,00	—
MXN 250.000	MXN 112.025	MXN 700.000	MXN 25.000	100,00	—
TRY 20.000	TRY 7.796	TRY 100.000	TRY 4.000	100,00	—
USD 10.000	USD 7.428	USD 50.000	USD 2.000	100,00	—
GBP 17.000	GBP 24.731	GBP 50.000	GBP 1.000	100,00	—
USD 55.000	USD 74.582	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
BRL 20.000	BRL 9.615	BRL 20.000	BRL 5.000	100,00	—
USD 10.000	USD 1.700	USD 10.000	USD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato, con preavviso di almeno 5 giorni in data 2-III-2022 ovvero in data 2-III-2024.
AUD 10.000	AUD 5.928	AUD 10.000	AUD 2.000	100,00	—
USD 10.000	USD 3.398	USD 10.000	USD 2.000	100,00	—
GBP 7.000	GBP 1.606	GBP 7.000	GBP 1.000	100,00	—
1.000.000	2.100	1.000.000	1000	100,00	—
850.000	600	850.000	1000	100,00	—
1.250.000	600	1.250.000	1000	100,00	—
1.250.000	1.200	1.250.000	1000	100,00	—
1.000.000	700	1.000.000	1000	99,59	—
900.000	700	900.000	100000	100,00	—
900.000	3.000	900.000	100000	100,00	—
USD 40.000	USD 14.768	USD 40.000	USD 2.000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 5,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al V-2018 pari al 5,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1241228649	Citigroup 2015-2023 Fixed to Capped Floating Rate Notes USD ¹⁾	0,80	2015	—	15-VI-2023	15-III; 15-IX	15-VI	USD 10.500	USD 5.380	USD 20.000	USD 2.000	100,00	—
XS1346520981	Citigroup Global Markets Holdings 2016-2021 USD Tasso Misto ²⁾	1,25	2016	—	03-III-2021	03-III; 03-IX	03-III	USD 20.000	USD 3.656	USD 20.000	USD 2.000	100,00	—
XS0604641034	CNH Industrial Finance Europe 2011-2018 6,25%	6,25	2011	—	09-III-2018	09-III	09-III	1.200.000	15.800	1.200.000	1000	100,00	—
XS1046851025	CNH Industrial Finance Europe 2014-2019 2,75%	2,75	2014	—	18-III-2019	18-III	18-III	1.000.000	37.500	1.000.000	1000	99,47	—
XS1114452060	CNH Industrial Finance Europe 2014-2021 2,875%	2,88	2014	—	27-IX-2021	27-IX	27-IX	700.000	42.400	700.000	1000	99,22	—
XS1412424662	CNH Industrial Finance Europe 2016-2023 2,875%	2,88	2016	—	17-V-2023	17-V	17-V	500.000	17.600	500.000	1000	100,00	—
XS1093338082	Credit Suisse 2014-2019 Yield Securities	0,39	2014	—	31-X-2019	31-I; 31-VII	31-X	USD 39.180	USD 2.642	USD 50.000	USD 1.000	100,00	—
XS1289106038	Credit Suisse 2016-2016 Tasso Misto USD ³⁾	1,50	2016	—	26-II-2026	26-II; 26-VIII	26-II	USD 100.000	USD 34.808	USD 100.000	USD 1.000	100,00	—
XS1355035335	Credit Suisse 2016-2024 Tasso Misto	4,00	2016	—	30-III-2024	30-III	30-III	15.000	3.070	100.000	1000	100,00	—
XS1289165711	Credit Suisse 2016-2026 3,5% USD	3,50	2016	—	26-I-2026	26-I	26-I	USD 100.000	USD 39.044	USD 100.000	USD 1.000	100,00	—
XS1396701168	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto GBP ⁴⁾	1,00	2016	—	07-VI-2026	07-III; 07-IX	07-VI	GBP 50.000	GBP 548	GBP 50.000	GBP 1.000	100,00	—
XS1354962273	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto USD ⁵⁾	4,30	2016	—	29-IV-2026	29-I; 29-VII	29-IV	USD 50.000	USD 10.735	USD 50.000	USD 1.000	100,00	—
XS1204154410	Crédit Agricole 2015-2027 2,625%	2,63	2015	—	17-III-2027	17-III	17-III	2.000.000	3.400	2.000.000	1000	100,00	—
DE000A1TNK86	Daimler 2013-2020 2%	2,00	2013	—	07-IV-2020	07-IV	07-IV	750.000	510	750.000	1000	99,21	—
DE000A1YC3F5	Daimler 2014-2017 Tasso Variabile	0,15	2014	—	27-I-2017	27-I; 27-VII	27-I	500.000	1.100	500.000	100000	99,94	—
DE000A11QSB8	Daimler 2014-2024 1,875%	1,88	2014	—	08-VII-2024	08-VII	08-VII	500.000	939	500.000	1000	99,07	—
FR0012432912	Danone 2015-2025 1,125%	1,13	2015	—	14-I-2025	14-I	14-I	750.000	900	750.000	100000	98,93	—
XS0166179381	Deutsche Telekom International Finance 2003-2018 6,625%	6,63	2003	—	29-III-2018	29-III	29-III	500.000	560	500.000	1000	99,00	—
XS0850057588	Deutsche Telekom International Finance 2012-2019 2%	2,00	2012	—	30-X-2019	30-X	30-X	500.000	1.140	500.000	1000	99,72	—
XS1382792197	Deutsche Telekom International Finance 2016-2023 0,625%	0,63	2016	—	03-IV-2023	03-IV	03-IV	1.750.000	854	1.750.000	1000	100,00	—
FR0010800540	EDF 2009-2024 4,625%	4,63	2009	—	11-IX-2024	11-IX	11-IX	2.500.000	1.250	2.500.000	50000	98,84	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 3,2%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al III-2017 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole annuali fisse in pagamento fino al 2018 pari al 6%. Successivamente cedole trimestrali indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al VI-2019 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al IV-2021 pari al 4,30%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1111324700	EDP Finance 2014-2022 2,625%	2,63	2014	—	18-I-2022	18-I	18-I	1.000.000	900	1.000.000	1000	99,31	—
XS0452187759	Enel Finance International 2009-2016 4%	4,00	2009	—	14-IX-2016	14-IX	14-IX	1.500.000	2.650	1.500.000	1000	99,54	—
XS0452187916	Enel Finance International 2009-2022 5%	5,00	2009	—	14-IX-2022	14-IX	14-IX	2.500.000	3.800	2.500.000	1000	99,21	—
XS0452188054	Enel Finance International 2009-2024 5,625% GBP	5,63	2009	—	14-VIII-2024	14-VIII	14-VIII	GBP 850.000	GBP 1.950	GBP 850.000	GBP 1.000	98,80	—
XS0452187320	Enel Finance International 2009-2040 5,75% GBP	5,75	2009	—	14-IX-2040	14-IX	14-IX	GBP 1.400.000	GBP 4.600	GBP 1.400.000	GBP 1.000	99,40	—
XS0695401801	Enel Finance International 2011-2018 5,75%	5,75	2011	—	24-X-2018	24-X	24-X	1.000.000	1.300	1.000.000	1000	99,34	—
XS0647298883	Enel Finance International 2011-2021 5%	5,00	2011	—	12-VII-2021	12-VII	12-VII	750.000	1.800	750.000	1000	99,48	—
XS0842659343	Enel Finance International 2012-2018 3,625%	3,63	2012	—	17-IV-2018	17-IV	17-IV	1.000.000	1.400	1.000.000	1000	99,47	—
XS0827692269	Enel Finance International 2012-2020 4,875%	4,88	2012	—	11-III-2020	11-III	11-III	1.000.000	4.900	1.000.000	1000	99,22	—
XS0842659426	Enel Finance International 2012-2023 4,875%	4,88	2012	—	17-IV-2023	17-IV	17-IV	1.000.000	2.700	1.000.000	1000	98,90	—
XS1176079843	Enel Finance International 2015-2025 1,966%	1,96	2015	—	27-I-2025	27-I	27-I	1.462.603	1.100	1.462.603	1000	100,00	—
XS0177089298	Enel Investment Holding 2003-2023 5,25%	5,25	2003	—	29-IX-2023	29-IX	29-IX	300.000	3.340	300.000	1000	98,76	—
FR0010952739	Engie 2010-2017 2,75%	2,75	2010	—	18-X-2017	18-X	18-X	1.000.000	1.000	1.000.000	1000	99,39	—
FR0010952770	Engie 2010-2022 3,5%	3,50	2010	—	18-X-2022	18-X	18-X	1.000.000	603	1.000.000	1000	99,50	—
XS1220057043	FCA Capital Ireland 2015-2017 Tasso Variabile	0,23	2015	—	17-X-2017	17-I; 17-VII	17-X	300.000	800	300.000	1000	100,00	—
XS1321405968	FCA Capital Ireland 2015-2018 1,25%	1,25	2015	—	13-VI-2018	13-VI	13-VI	500.000	1.100	500.000	1000	100,00	—
XS1220057472	FCA Capital Ireland 2015-2020 1,375%	1,38	2015	—	17-IV-2020	17-IV	17-IV	700.000	2.900	700.000	1000	100,00	—
XS1380394806	Ferrari 2016-2023 1,5%	1,50	2016	—	16-III-2023	16-III	16-III	500.000	11.300	500.000	1000	100,00	—
XS1057487875	FGA Capital Ireland 2014-2019 2,625%	2,63	2014	—	17-IV-2019	17-IV	17-IV	750.000	1.400	750.000	1000	99,50	—
US31562QAC15	Fiat Chrysler Automobiles 2015-2020 4,5% USD	4,50	2015	—	15-IV-2020	15-IV	15-IV	USD 1.460.345	USD 4.200	USD 1.460.345	USD 1.000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
				Primo rimborso	Ultimo rimborso									
XS1388625425	Fiat Chrysler Automobiles 2016-2024 3,75%	3,75	2016	—	29-III-2024	29-III	29-III	1.250.000	148.800	1.250.000	1000	100,00	—	
XS0647264398	Fiat Chrysler Finance Europe 2011-2018 7,375%	7,38	2011	—	09-VII-2018	09-VII	09-VII	600.000	14.100	600.000	1000	100,00	—	
XS0805410239	Fiat Chrysler Finance Europe 2012-2016 7,75%	7,75	2012	—	17-X-2016	17-X	17-X	600.000	15.500	600.000	1000	100,00	—	
XS0764640149	Fiat Chrysler Finance Europe 2012-2017 7%	7,00	2012	—	23-III-2017	23-III	23-III	850.000	20.600	850.000	1000	100,00	—	
XS0906420574	Fiat Chrysler Finance Europe 2013-2018 6,625%	6,63	2013	—	15-III-2018	15-III	15-III	1.250.000	31.100	1.250.000	1000	100,00	—	
XS0953215349	Fiat Chrysler Finance Europe 2013-2019 6,75%	6,75	2013	—	14-X-2019	14-X	14-X	850.000	37.000	850.000	1000	100,00	—	
XS1048568452	Fiat Chrysler Finance Europe 2014-2021 4,75%	4,75	2014	—	22-III-2021	22-III	22-III	1.000.000	99.900	1.000.000	1000	100,00	—	
XS1088515207	Fiat Chrysler Finance Europe 2014-2022 4,75%	4,75	2014	—	15-VII-2022	15-VII	15-VII	850.000	166.100	850.000	1000	100,00	—	
XS0305093311	Fiat Chrysler Finance North America 2007-2017 5,625% Callable	5,63	2007	—	12-VI-2017	12-VI	12-VI	1.000.000	40.850	1.000.000	50000	99,23	—	
FR0000471930	France Telecom 2003-2033 8,125%	8,13	2003	—	28-I-2033	28-I	28-I	1.500.000	710	1.500.000	1000	103,24	—	
XS1042118106	GE Capital 2014-2020 2,5% USD	2,50	2014	—	28-III-2020	28-III	28-III	USD 505.000	USD 109.308	USD 505.000	USD	2.000	99,76	—
XS1042118288	GE Capital 2014-2020 Floating Rate USD	0,26	2014	—	28-III-2020	28-III; 28-IX	28-III	USD 245.000	USD 45.504	USD 245.000	USD	2.000	100,00	—
XS0272770396	GE Capital European Funding 2006-2016 4,125%	4,13	2006	—	27-X-2016	27-X	27-X	1.500.000	1.467	1.500.000	1000	99,17	—	
XS0254356057	GE Capital European Funding 2006-2021 Tasso Variabile	0,05	2006	—	17-V-2021	17-II; 17-VIII	17-V	1.000.000	3.200	1.000.000	1000	99,70	—	
XS0626808496	GE Capital European Funding 2011-2017 3,625%	3,63	2011	—	15-VI-2017	15-VI	15-VI	460.000	3.956	460.000	1000	99,41	—	
XS0626808223	GE Capital European Funding 2011-2017 Floating Rate	0,35	2011	—	15-VI-2017	15-VI	15-VI	440.000	3.967	440.000	1000	100,00	—	
XS0874840845	GE Capital European Funding 2013-2023 2,625%	2,63	2013	—	15-III-2023	15-III	15-III	1.000.000	561	1.000.000	1000	99,31	—	
FR0010014845	GIE PSA Tresorerie 2003-2033 6%	6,00	2003	—	19-IX-2033	19-IX	19-IX	600.000	79.946	600.000	1000	99,83	—	
XS0974877150	Glencore Finance Europe 2013-2020 3,375%	3,38	2013	—	30-IX-2020	30-IX	30-IX	750.000	8.500	750.000	1000	99,65	—	
XS1051003538	Glencore Finance Europe 2014-2021 2,75%	2,75	2014	—	01-IV-2021	01-IV	01-IV	600.000	2.200	600.000	1000	99,45	—	

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1110430193	Glencore Finance Europe 2014-2022 1,625%	1,63	2014	—	18-I-2022	18-I	18-I	700.000	3.400	700.000	1000	99,24	—
XS1050842423	Glencore Finance Europe 2014-2026 3,75%	3,75	2014	—	01-IV-2026	01-IV	01-IV	500.000	3.200	500.000	1000	99,43	—
XS1202846819	Glencore Finance Europe 2015-2021 1,25%	1,25	2015	—	17-III-2021	17-III	17-III	1.250.000	1.100	1.250.000	1000	99,70	—
XS1202849086	Glencore Finance Europe 2015-2025 1,75%	1,75	2015	—	17-III-2025	17-III	17-III	750.000	4.800	750.000	1000	99,27	—
XS1166507548	Goldman Sachs 2015-2024 1,75%	1,75	2015	—	29-V-2024	29-V	29-V	100.000	1.584	100.000	1000	100,00	—
XS0882849507	Goldman Sachs Group 2013-2023 3,25%	3,25	2013	—	01-II-2023	01-II	01-II	1.000.000	657	1.000.000	1000	99,03	—
XS1130101931	Goldman Sachs Group 2014-2019 Tasso Variabile	0,21	2014	—	29-X-2019	29-I; 29-VII	29-X	1.250.000	1.456	1.250.000	1000	99,85	—
XS1116263325	Goldman Sachs Group 2014-2024 2,125%	2,13	2014	—	30-IX-2024	30-IX	30-IX	1.000.000	607	1.000.000	1000	99,80	—
XS1240146891	Goldman Sachs Group 2015-2020 Tasso Variabile	0,17	2015	—	29-V-2020	29-II; 29-VIII	29-V	1.500.000	907	1.500.000	1000	100,00	—
XS1173845436	Goldman Sachs Group 2015-2022 1,375%	1,38	2015	—	26-VII-2022	26-VII	26-VII	1.000.000	1.127	1.000.000	1000	99,24	—
XS1213053991	Goldman Sachs International 2015-2021 4% NZD	4,00	2015	—	13-VII-2021	13-VII	13-VII	NZD 50.000	NZD 12.192	NZD 50.000	NZD 2.000	100,00	—
XS1166378718	Goldman Sachs International 2015-2023 3,5% AUD	3,50	2015	—	28-IV-2023	28-IV	28-IV	AUD 50.000	AUD 11.844	AUD 50.000	AUD 2.000	100,00	—
XS1013006090	Goldman Sachs International 2015-2025 3% USD	3,00	2015	—	23-I-2025	23-I	23-I	USD 100.000	USD 68.396	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
XS1241026936	Goldman Sachs International 2015-2025 3,5% Callable USD	3,50	2015	—	15-IX-2025	15-IX	15-IX	USD 100.000	USD 79.392	USD 100.000	USD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 15-IX-2018, con preavviso di almeno 10 giorni.
XS1241085353	Goldman Sachs International 2015-2027 Fixed to Floating ¹⁾	0,75	2015	—	26-XI-2027	26-II; 26-VIII	26-XI	50.000	7.873	50.000	1000	100,00	—
XS1267261805	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating USD ²⁾	6,00	2016	—	15-I-2026	15-I; 15-VII	15-I	USD 100.000	USD 67.176	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
XS1317259148	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating USD ³⁾	1,06	2016	—	22-IV-2026	22-I; 22-VII	22-IV	USD 100.000	USD 12.918	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
XS1317278361	Goldman Sachs International 2016-2026 Switchable Fixed to Floating USD ⁴⁾	4,65	2016	—	17-V-2026	17-V	17-V	USD 100.000	USD 1.924	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al IV-2019 pari al 4,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al V-2018 pari al 4,65%. Successivamente, con preavviso di almeno 5 giorni, possibilità di trasformarle in cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1317187646	Goldman Sachs International 2016-2028 Tasso Misto ¹⁾	3,50	2016	—	10-III-2028	10-III	10-III	75.000	2.265	75.000	1000	100,00	—
XS1254428896	HSBC Holdings 2015-2025 3%	3,00	2015	—	30-VI-2025	30-VI	30-VI	1.500.000	600	1.500.000	1000	100,00	—
XS0494868630	Iberdrola Finanzas 2010-2020 4,125%	4,13	2010	—	23-III-2020	23-III	23-III	500.000	700	500.000	50000	99,26	—
XS1171541813	Iberdrola International 2015-2023 1,12%	1,12	2015	—	27-I-2023	27-I	27-I	600.000	600	600.000	100000	99,39	—
XS0496716282	Italcementi Finance 2010-2020 5,375%	5,38	2010	—	19-III-2020	19-III	19-III	750.000	23.900	750.000	1000	99,22	—
XS0893201433	Italcementi Finance 2013-2018 6,125%	6,13	2013	—	21-II-2018	21-II	21-II	350.000	7.800	350.000	1000	99,48	—
XS1308021846	IVS Group 2015-2022 4,5% Callable	4,50	2015	—	15-XI-2022	15-XI	15-XI	240.000	427.924	240.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato a partire dal 15-XI-2016, con preavviso di almeno 10 giorni. Qualora l'emittente rimborsi nel 2018 rimborserà il 102,25% del valore nominale residuo; qualora rimborsi nel 2019 il 101,125%; qualora rimborsi nel 2020 il 100,563%, successivamente il 100%.
XS1174469137	J.P. Morgan Chase & Co. 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	27-I-2025	27-I	27-I	1.500.000	900	1.500.000	1000	99,95	—
XS1069522057	Jefferies Group 2014-2020 2,375%	2,38	2014	—	20-V-2020	20-V	20-V	500.000	1.400	500.000	1000	99,75	—
IT0006598830	KFW 2005-2025 Fixed to CMS Cap-ped	0,94	2005	—	09-XII-2025	09-XII	09-XII	50.000	3.348	50.000	1000	100,00	—
XS0619263485	KFW 2011-18 3,125% USD	3,13	2011	—	20-IV-2018	20-IV	20-IV	USD 1.000.000	USD 1.033	USD 1.000.000	USD 1.000	99,50	—
XS0817659526	KFW 2012-2017 3,75% NZD	3,75	2012	—	16-VIII-2017	16-VIII	16-VIII	NZD 800.000	NZD 2.795	NZD 800.000	NZD 1.000	101,47	—
XS0838228996	KFW 2012-2017 5% ZAR	5,00	2012	—	04-X-2017	04-X	04-X	ZAR 3.000.000	ZAR 27.535	ZAR 3.000.000	ZAR 5.000	100,59	—
XS0816374663	KFW 2012-2019 1,625% USD	1,63	2012	—	15-VIII-2019	15-VIII	15-VIII	USD 2.500.000	USD 1.606	USD 2.500.000	USD 1.000	99,83	—
XS0864257349	KFW 2013-2016 5% TRY	5,00	2013	—	04-VIII-2016	04-VIII	04-VIII	TRY 805.000	TRY 2.266	TRY 805.000	TRY 1.000	100,92	—
XS0973219065	KFW 2013-2016 9,5% BRL	9,50	2013	—	15-XII-2016	15-XII	15-XII	BRL 700.000	BRL 36.920	BRL 700.000	BRL 5.000	99,95	—
XS0907335599	KFW 2013-2018 5,75% TRY	5,75	2013	—	22-III-2018	22-III	22-III	TRY 510.000	TRY 4.453	TRY 510.000	TRY 1.000	101,41	—
XS0979312914	KFW 2013-2018 7% ZAR	7,00	2014	—	09-IV-2018	09-IV	09-IV	ZAR 300.000	ZAR 18.540	ZAR 300.000	ZAR 5.000	100,98	—
XS1014862731	KFW 2014-2017 10,5% BRL	10,50	2014	—	14-XII-2017	14-XII	14-XII	BRL 340.000	BRL 6.935	BRL 340.000	BRL 5.000	101,38	—
XS1020328024	KFW 2014-2017 9,75% BRL	9,75	2014	—	23-V-2017	23-V	23-V	BRL 150.000	BRL 5.820	BRL 150.000	BRL 5.000	100,67	—
XS1315160702	KFW 2015-2019 12% BRL	12,00	2015	—	04-XI-2019	04-XI	04-XI	BRL 250.000	BRL 2.390	BRL 250.000	BRL 5.000	98,65	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 3,5%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
US500769GQ12	KFW 2015-2025 2% USD	2,00	2015	—	02-V-2025	02-V	02-V
XS0562783034	Lafarge 2010-2018 5,375%	5,38	2010	—	29-XI-2018	29-XI	29-XI
XS0449361350	Lloyds TSB Bank 2009-2019 5,375%	5,38	2009	—	03-IX-2019	03-IX	03-IX
XS0497187640	Lloyds TSB Bank 2010-2020 Lower-Tier2 6,5%	6,50	2010	—	24-III-2020	24-III	24-III
IT0006719584	Macquarie Structured Securities 2011-2017 Step Up Energy ¹⁾	6,00	2011	—	21-IV-2017	21-IV	21-IV
DE000A13R8M3	Metro 2014-2021 1,375%	1,38	2014	—	28-X-2021	28-X	28-X
XS1203941775	Metro 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	19-III-2025	19-III	19-III
XS1366716261	Morgan Stanley 2016-2021 Fixed Rate Step-Up GBP ²⁾	1,50	2016	—	29-III-2021	29-III	29-III
XS0969795680	Nestlé Finance International 2013-2021 2,125%	2,13	2013	—	10-IX-2021	10-IX	10-IX
FR0012173862	Pernod Ricard 2014-2024 2,125%	2,13	2014	—	27-IX-2024	27-IX	27-IX
FR0010957282	Peugeot 2010-2016 5%	5,00	2010	—	28-X-2016	28-X	28-X
FR0011233451	Peugeot 2012-22017 5,625%	5,63	2012	—	11-VII-2017	11-VII	11-VII
FR0011439975	Peugeot 2013-2018 7,375%	7,38	2013	—	06-III-2018	06-III	06-III
FR0011567940	Peugeot 2013-2019 6,5%	6,50	2013	—	18-I-2019	18-I	18-I
FR0013153707	Peugeot 2016-2023 2,375%	2,38	2016	—	14-IV-2023	14-IV	14-IV
XS0215828913	Portugal Telecom International Finance 2005-2017 4,37%	4,37	2005	—	24-III-2017	24-III	24-III
XS0462994343	Portugal Telecom International Finance 2009-2019 5%	5,00	2009	—	04-XI-2019	04-XI	04-XI
XS0927581842	Portugal Telecom International Finance 2013-2020 4,625%	4,63	2013	—	08-V-2020	08-V	08-V
XS0503734872	Rabobank 2010-2017 3,375%	3,38	2010	—	21-IV-2017	21-IV	21-IV
XS0478074924	Rabobank Nederland 2010-2020 4,125%	4,13	2010	—	14-I-2020	14-I	14-I
XS1180130939	Rabobank Nederland 2015-2027 1,375%	1,38	2015	—	03-II-2027	03-II	03-II
XS0775870982	RCI Banque 2012-2017 4,25%	4,25	2012	—	27-IV-2017	27-IV	27-IV

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
USD 3.000.000	USD 1.114	USD 3.000.000	USD 1.000	99,64	—
1.000.000	1.250	1.000.000	1000	99,73	—
1.500.000	750	1.500.000	1000	99,92	—
1.500.000	2.850	1.500.000	1000	99,71	—
35.000	1.536	35.000	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
500.000	4.038	500.000	1000	99,25	—
600.000	1.788	600.000	1000	99,83	—
GBP 7.500	GBP 568	GBP 7.500	GBP 1.000	100,00	—
500.000	1.081	500.000	1000	99,71	—
650.000	700	650.000	100000	100,00	—
500.000	5.296	500.000	1000	99,32	—
600.000	5.471	600.000	1000	99,47	—
1.000.000	8.537	1.000.000	1000	99,49	—
600.000	6.292	600.000	1000	99,37	—
500.000	1.163	500.000	1000	100,00	—
382.098	20.600	382.098	1000	99,80	—
750.000	66.050	750.000	1000	99,63	—
1.000.000	62.700	1.000.000	1000	100,00	—
2.000.000	513	2.000.000	1000	99,56	—
3.500.000	605	3.500.000	1000	99,58	—
1.500.000	1.372	1.500.000	1000	99,11	—
650.000	1.100	650.000	1000	99,44	—

1) Cedole fisse a crescere pari al 3% per i primi due anni, 4%, 5% e 6% annuo fino al 2016. Successivamente cedole indicizzate. -

2) Cedole crescenti di 0,10% per anno.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1075471265	RCI Banque 2014-2017 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,24	2014	—	13-VI-2017	13-III; 13-IX	13-VI	600.000	2.144	600.000	1000	100,00	—
FR0012173144	RCI Banque 2014-2019 1,125% Callable	1,13	2014	—	30-IX-2019	30-IX	30-IX	600.000	1.184	600.000	1000	99,84	—
FR0012674182	RCI Banque 2015-2018 Tasso Variabile	0,15	2015	—	16-VII-2018	16-I; 16-VII	16-VII	750.000	714	750.000	1000	100,00	—
FR0012596179	RCI Banque 2015-2020 0,625%	0,63	2015	—	04-III-2020	04-III	04-III	500.000	1.399	500.000	1000	99,83	—
FR0012759744	RCI Banque 2015-2022 1,25%	1,25	2015	—	08-VI-2022	08-VI	08-VI	750.000	1.040	750.000	1000	99,36	—
FR0010871541	Renault 2010-2017 5,625%	5,63	2010	—	22-III-2017	22-III	22-III	500.000	2.012	500.000	1000	99,39	—
FR0011568963	Renault 2013-2018 3,625%	3,63	2013	—	19-IX-2018	19-IX	19-IX	600.000	1.589	600.000	1000	99,59	—
FR0011769090	Renault 2014-2021 3,125%	3,13	2014	—	05-III-2021	05-III	05-III	500.000	1.620	500.000	1000	99,65	—
XS0975256685	Repsol International Finance 2013-2021 3,625%	3,63	2013	—	07-X-2021	07-X	07-X	1.000.000	4.200	1.000.000	100000	99,73	—
XS1334225361	Repsol International Finance 2015-2020 2,125%	2,13	2015	—	16-XII-2020	16-XII	16-XII	600.000	700	600.000	100000	99,90	—
FR0013152899	RTE 2016-2026 1%	1,00	2016	—	19-X-2026	19-X	19-X	650.000	3.400	650.000	100000	100,00	—
XS0162513211	RWE Finance 2003-2033 5,75%	5,75	2003	—	14-II-2033	14-II	14-II	600.000	531	600.000	1000	98,67	—
XS1201001572	Santander Issuance 2015-2025 2,5%	2,50	2015	—	18-III-2025	18-III	18-III	1.500.000	700	1.500.000	100000	100,00	—
XS1384064587	Santander Issuances 2016-2026 3,25%	3,25	2016	—	04-IV-2026	04-IV	04-IV	1.500.000	600	1.500.000	100000	100,00	—
XS1119084942	SG Issuer 2014-2016 10% BRL	10,00	2014	—	05-XII-2016	05-XII	05-XII	BRL 90.000	BRL 27.609	BRL 90.000	BRL 3.000	100,00	—
XS1119130489	SG Issuer 2014-2018 3,75% MXN	3,75	2014	—	04-XII-2018	04-XII	04-XII	MXN 500.000	MXN 10.128	MXN 500.000	MXN 16.000	100,00	—
XS1202764681	SG Issuer 2015-2017 5% INR	5,00	2015	—	27-IV-2017	27-IV	27-IV	INR 1.750.000	INR 216.020	INR 1.750.000	INR 70.000	100,00	—
XS1202763360	SG Issuer 2015-2017 8,5% TRY	8,50	2015	—	27-IV-2017	27-IV	27-IV	TRY 90.000	TRY 1.707	TRY 90.000	TRY 3.000	100,00	—
XS1202764335	SG Issuer 2015-2018 10,5% RUB	10,50	2015	—	27-IV-2018	27-IV	27-IV	RUB 1.750.000	RUB 724.920	RUB 1.750.000	RUB 70.000	100,00	—
XS1144002463	SG Issuer 2015-2019 7,25% IDR	7,25	2015	—	29-I-2019	29-I	29-I	IDR 375.000.000	IDR 47.460.000	IDR 375.000.000	IDR 15.000.000	100,00	—
XS1212331265	SG Issuer 2015-2025 Indicizzato USD ¹⁾	1,06	2015	—	23-VI-2025	22-III; 22-IX	23-VI	USD 100.000	USD 69.233	USD 100.000	USD 1.000	100,00	—
XS1135276332	Shell International Finance 2014-2022 1%	1,00	2014	—	06-IV-2022	06-IV	06-IV	1.000.000	1.000	1.000.000	1000	99,80	—
XS1265876430	Société Générale 2015-2023 Tasso Misto USD ²⁾	1,25	2015	—	23-X-2023	23-I; 23-VII	23-X	USD 80.000	USD 48.030	USD 80.000	USD 2.000	100,00	—

Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 4,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
XS1212158965	Société Générale 2015-2025 3% Callable USD	3,00	2015	—	05-VIII-2025	05-VIII	05-VIII
XS1265944964	Société Générale 2016-2026 Tasso Misto USD ¹⁾	1,31	2016	—	03-III-2026	03-III; 03-IX	03-III
XS1236574627	Société Générale 2016-2028 Tasso Misto ²⁾	0,88	2016	—	04-I-2028	04-I; 04-VII	04-I
XS1236580517	Société Générale 2016-2028 Tasso Misto USD ³⁾	1,25	2016	—	04-I-2028	04-I; 04-VII	04-I
XS0161100515	Telecom Italia Finance 2003-2033 7,75%	7,75	2003	—	24-I-2033	24-I	24-I
XS0907289978	Telefonica Emisiones 2013-2021 3,961%	3,96	2013	—	26-III-2021	26-III	26-III
XS1069430368	Telefonica Emisiones 2014-2022 2,24%	2,24	2014	—	27-V-2022	27-V	27-V
XS0999667263	Telekom Finanzmanagement 2013-2021 3,125%	3,13	2013	—	03-XII-2021	03-XII	03-XII
XS1082970853	Tesco Corporate Treasury Services 2014-2019 1,375%	1,38	2014	—	01-VII-2019	01-VII	01-VII
XS0454984765	The Royal Bank of Scotland 2009-2019 5,375%	5,38	2009	—	30-IX-2019	30-IX	30-IX
NL0009537943	The Royal Bank of Scotland 2010-2016 Obbligazione Royal 3% Variabile	0,75	2010	—	30-IX-2016	30-III; 30-IX	30-IX
NL0009537851	The Royal Bank of Scotland 2010-2016 Obbligazione Royal Scala Crescente ⁴⁾	3,00	2010	—	30-IX-2016	30-III	30-IX
NL0009403229	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Fixed to Floating Rate Note ⁵⁾	0,25	2010	—	03-V-2017	03-V	03-V
NL0009560002	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Obbligazione Royal Euribor con Leva ⁶⁾	0,00	2010	—	30-IX-2017	30-III; 30-IX	30-IX
NL0009560010	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Obbligazione Royal Step Down ⁷⁾	3,65	2010	—	30-IX-2017	30-III	30-IX
NL0009294040	The Royal Bank of Scotland 2010-2018 Obbligazione Royal Combinazione Perfetta ⁸⁾	10,26	2010	—	23-III-2018	23-III	23-III

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
USD 150.000	USD 20.082	USD 150.000	USD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 5-VIII-2018, con preavviso di almeno 15 giorni.
USD 50.000	USD 4.360	USD 50.000	USD 2.000	100,00	—
60.000	4.310	60.000	2000	100,00	—
USD 80.000	USD 6.994	USD 80.000	USD 2.000	100,00	—
1.015.000	87.072	1.015.000	1000	98,24	—
1.000.000	800	1.000.000	100000	100,00	—
1.250.000	700	1.250.000	100000	100,00	—
750.000	553	750.000	1000	99,37	—
1.250.000	700	1.250.000	1000	99,68	—
2.000.000	1.400	2.000.000	1000	99,43	—
34.904	2.791	100.000	1000	100,00	—
67.795	7.924	100.000	1000	100,00	—
4.762	1.183	22.050	1000	100,00	—
7.540	2.027	100.000	1000	100,00	—
6.320	684	100.000	1000	100,00	—
24.578	4.677	200.000	1000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 5,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 3,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2019 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse a crescere pari al 3%, 3,25%, 3,5%, 3,75%, 4% e 4,25% annuo. - 5) Cedole fisse pari al 2,80% per gli anni 2009 e 2010 e par al 3,20% per gli anni 2011 e 2012. Successivamente cedole indicizzate. 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2011 pari al 6,55%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse a decrescere pari al 5%, 4,65%, 4,3%, 4%, 3,7%, 3,35% e 3% annuo. - 8) Cedole fisse in pagamento fino al 2011 pari all'8%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
NL0009294032	The Royal Bank of Scotland 2010-2018 Obbligazione Royal Protezione ¹⁾	2,75	2010	—	23-III-2018	23-III	23-III	7.152	1.509	100.000	1000	100,00	—
XS0496481200	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 5,5%	5,50	2010	—	23-III-2020	23-III	23-III	1.000.000	600	1.000.000	1000	99,30	—
NL0009483825	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 5%	5,00	2010	—	22-VI-2020	22-VI	22-VI	114.544	9.548	250.000	1000	100,00	—
NL0009294057	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 5% Flex ²⁾	0,00	2010	—	23-III-2020	23-III	23-III	28.731	25.148	100.000	1000	100,00	—
NL0009483833	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 8% Steepener ³⁾	3,00	2010	—	22-VI-2020	22-VI	22-VI	18.667	2.483	150.000	1000	100,00	—
NL0009408467	The Royal Bank of Scotland 2010-2022 Obbligazione Royal Operazione 10%	10,28	2010	—	05-V-2022	05-V	05-V	16.262	3.475	200.000	1000	100,00	—
NL0009487453	The Royal Bank of Scotland 2010-2025 Obbligazione Royal Top Inverse ⁴⁾	2,25	2010	—	09-VII-2025	09-I; 09-VII	09-VII	19.401	4.651	100.000	1000	100,00	—
GB00B6HYM000	The Royal Bank of Scotland 2011-2016 Obbligazione BRIC	0,00	2011	—	29-XII-2016	29-XII	29-XII	7.500	3.041	7.500	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
GB00B6HZ2927	The Royal Bank of Scotland 2011-2016 Tasso Misto con Cap&Floor ⁵⁾	3,00	2011	—	29-VII-2016	29-I	29-VII	15.949	2.632	41.500	1000	100,00	—
IT0006719469	The Royal Bank of Scotland 2011-2017 3,1% Step Up ⁶⁾	5,10	2011	—	26-V-2017	26-V	26-V	54.807	4.707	87.500	1000	100,00	—
GB00B6HZ3D39	The Royal Bank of Scotland 2011-2017 Obbligazioni Inflazione Europea ⁷⁾	1,00	2011	—	29-VI-2017	29-VI	29-VI	15.102	3.843	44.220	1000	100,00	—
GB00B6HZ3R74	The Royal Bank of Scotland 2011-2017 Obiettivo 6%	0,00	2011	—	02-VI-2017	02-III; 02-IX	02-VI	5.200	2.300	50.000	1000	100,00	—
NL0009694272	The Royal Bank of Scotland 2011-2021 5,3%	5,30	2011	—	14-II-2021	14-II	14-II	7.275	523	100.000	1000	100,00	—
XS1382368113	The Royal Bank of Scotland 2016-2023 2,5%	2,50	2016	—	22-III-2023	22-III	22-III	1.500.000	3.700	1.500.000	1000	99,30	—
DE000A1MA9H4	Thyssenkrupp 2012-2017 4,375%	4,38	2012	—	28-II-2017	28-II	28-II	1.250.000	1.964	1.250.000	1000	99,75	—
DE000A1R08U3	Thyssenkrupp 2013-2018 4%	4,00	2013	—	27-VIII-2018	27-VIII	27-VIII	1.600.000	1.148	1.600.000	1000	99,68	—
DE000A1R0410	Thyssenkrupp 2014-2019 3,125%	3,13	2014	—	25-X-2019	25-X	25-X	1.250.000	3.986	1.250.000	1000	99,20	—
DE000A14J579	Thyssenkrupp 2015-2020 1,75%	1,75	2015	—	25-XI-2020	25-XI	25-XI	750.000	7.896	750.000	1000	99,33	—
DE000A14J587	Thyssenkrupp 2015-2025 2,5%	2,50	2015	—	25-II-2025	25-II	25-II	600.000	19.981	600.000	1000	98,82	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 5%. Successivamente eventuali cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari all'8%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 12%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse a crescere pari al 3,1%, 3,6%, 4,1%, 4,6%, 5,1% e 5,6% annuo. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
DE000A2AAPF1	Thyssenkrupp 2016-2021 2,75% Callable	2,75	2016	—	08-III-2021	08-III	08-III	750.000	3.240	750.000	1000	99,43	Facoltà di rimborso anticipato in data 8-XII- 2020 con preavviso di almeno 60 giorni e non oltre i 90.
XS0541787783	Total Capital 2010-2022 3,125%	3,13	2010	—	16-IX-2022	16-IX	16-IX	500.000	2.439	500.000	1000	99,31	—
XS1111559768	Total Capital Canada 2014-2022 1,12%	1,12	2014	—	18-III-2022	18-III	18-III	1.000.000	1.100	1.000.000	100000	99,80	—
XS1139315581	Total Capital International 2014-2025 1,375%	1,38	2014	—	19-III-2025	19-III	19-III	850.000	700	850.000	100000	98,97	—
DE000UB2F5S4	UBS 2010-2017 4%	4,00	2010	—	29-VII-2017	29-VII	29-VII	70.000	3.420	70.000	1000	100,00	—
XS1109802568	Vodafone Group 2014-2025 1,875%	1,88	2014	—	11-IX-2025	11-IX	11-IX	1.000.000	700	1.000.000	1000	98,91	—
XS1372838083	Vodafone Group 2016-2019 Tasso Variabile	0,19	2016	—	25-II-2019	25-II; 25-VIII	25-II	1.750.000	700	1.750.000	1000	100,00	—
XS1031018911	Volkswagen Bank 2014-2019 1,5%	1,50	2014	—	13-II-2019	13-II	13-II	750.000	2.057	750.000	1000	99,54	—
XS1216646825	Volkswagen Financial Services 2015-2017 Tasso Variabile	0,07	2015	—	16-X-2017	16-I; 16-VII	16-X	500.000	675	500.000	1000	100,00	—
XS1216647716	Volkswagen Financial Services 2015-2021 0,75%	0,75	2015	—	14-X-2021	14-X	14-X	750.000	10.063	750.000	1000	99,94	—
XS0168881760	Volkswagen International Finance 2003-2018 5,375%	5,38	2003	—	22-V-2018	22-V	22-V	500.000	1.291	500.000	1000	98,97	—
XS0782708456	Volkswagen International Finance 2012-2017 1,875%	1,88	2012	—	15-V-2017	15-V	15-V	1.500.000	2.444	1.500.000	1000	99,38	—
XS0731681556	Volkswagen International Finance 2012-2019 3,25%	3,25	2012	—	21-I-2019	21-I	21-I	1.250.000	3.709	1.250.000	1000	99,38	—
XS0873793375	Volkswagen International Finance 2013-2020 2%	2,00	2013	—	14-I-2020	14-I	14-I	1.000.000	9.458	1.000.000	1000	99,69	—
XS0909788290	Volkswagen International Finance 2013-2021 2%	2,00	2013	—	26-III-2021	26-III	26-III	1.000.000	4.286	1.000.000	1000	99,42	—
XS0908570459	Volkswagen International Finance 2013-2033 3,3%	3,30	2013	—	22-III-2033	22-III	22-III	850.000	700	850.000	100000	100,00	—
XS1167637294	Volkswagen International Finance 2015-2018 Tasso Variabile	0,07	2015	—	16-VII-2018	16-I; 16-VII	16-VII	1.000.000	3.337	1.000.000	1000	100,00	—
XS1167644407	Volkswagen International Finance 2015-2023 0,875%	0,88	2015	—	16-I-2023	16-I	16-I	1.000.000	6.129	1.000.000	1000	99,08	—
XS1167667283	Volkswagen International Finance 2015-2030 1,625%	1,63	2015	—	16-I-2030	16-I	16-I	1.000.000	28.771	1.000.000	1000	98,99	—
XS0823975585	Volkswagen Leasing 2012-2022 2,375%	2,38	2012	—	06-IX-2022	06-IX	06-IX	1.000.000	900	1.000.000	100000	99,63	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1050916649	Volkswagen Leasing 2014-2017 1%	1,00	2014	—	04-X-2017	04-X	04-X	750.000	1.088	750.000	1000	99,73	—
XS1050917373	Volkswagen Leasing 2014-2022 2,125%	2,13	2014	—	04-IV-2022	04-IV	04-IV	750.000	3.878	750.000	1000	99,51	—
XS1014610254	Volkswagen Leasing 2014-2024 2,625%	2,63	2014	—	15-I-2024	15-I	15-I	1.250.000	10.784	1.250.000	1000	98,92	—
XS1273542867	Volkswagen Leasing 2015-2017 Tasso Variabile	0,06	2015	—	11-VIII-2017	11-II	11-VIII	750.000	1.077	750.000	1000	100,00	—
						11-VIII							—
XS1273507100	Volkswagen Leasing 2015-2020 0,75%	0,75	2015	—	11-VIII-2020	11-VIII	11-VIII	750.000	2.168	750.000	1000	99,57	—
DI ENTI INTERNAZIONALI													
XS0055498413	BEI 1995-2017 8,75% GBP	8,75	2008	—	25-VIII-2017	25-VIII	25-VIII	GBP 1.000.000	GBP 1.104	GBP 1.000.000	GBP 1.000	99,83	—
IT0006506007	BEI 1996-2016 Zero Coupon	—	1996	—	06-XII-2016	—	06-XII	512.321	18.030	516.456	0,01	24,32	—
IT0006515628	BEI 1997-2017 Trasformato in Tasso Fisso	2,54	1997	—	20-II-2017	20-II	20-II	431.635	13.541	692.051	0,01	24,66	—
IT0006525932	BEI 1998-2018 Sticky Fixed Reverse Floater	9,17	1998	—	20-XI-2018	20-XI	20-XI	111.931	5.236	154.937	0,01	100,00	—
XS0086358628	BEI 1998-2018 Zero Coupon ZAR	—	1998	—	31-XII-2018	—	31-XII	ZAR 888.490	ZAR 58.075	ZAR 888.490	ZAR 5.000	8,70	—
XS0091457027	BEI 1998-2021 5,375% GBP	5,38	2008	—	07-VI-2021	07-VI	07-VI	GBP 1.875.000	GBP 1.228	GBP 1.875.000	GBP 1.000	99,72	—
XS0085727559	BEI 1998-2028 6% GBP	6,00	2008	—	07-XII-2028	07-XII	07-XII	GBP 3.700.000	GBP 861	GBP 3.700.000	GBP 1.000	99,16	—
IT0006527052	BEI 1999-2019 Eurostability Bond	0,00	1999	—	05-II-2019	—	05-II	125.342	6.643	150.000	1000	100,00	—
IT0006526609	BEI 1999-2029 Fixed & Zero	0,00	1999	—	22-I-2029	22-I	22-I	174.582	5.093	200.000	1000	100,00	—
IT0006527300	BEI 1999-2029 Step-Down	0,00	1999	—	26-II-2029	26-II	26-II	57.000	3.876	75.000	1000	100,00	—
XS0096499057	BEI 1999-2039 5% GBP	5,00	2008	—	15-IV-2039	15-IV	15-IV	GBP 1.600.000	GBP 392	GBP 1.600.000	GBP 1.000	99,74	—
XS0110373569	BEI 2000-2025 5,5% GBP	5,50	2008	—	15-IV-2025	15-IV	15-IV	GBP 1.500.000	GBP 1.509	GBP 1.500.000	GBP 1.000	99,54	—
XS0114126294	BEI 2000-2032 5,625% GBP	5,63	2008	—	07-VI-2032	07-VI	07-VI	GBP 2.275.000	GBP 1.125	GBP 2.275.000	GBP 1.000	99,12	—
XS0160386875	BEI 2003-2018 4,75% GBP	4,75	2003	—	15-X-2018	15-X	15-X	GBP 600.000	GBP 707	GBP 600.000	GBP 1.000	99,32	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS0196448129	BEI 2004-2020 4,625%	4,63	2004	—	15-IV-2020	15-IV	15-IV	5.000.000	4.416	5.000.000	1000	98,96	—
XS0219399275	BEI 2004-2020 5% SEK	5,00	2004	—	01-XII-2020	01-XII	01-XII	SEK 5.525.000	SEK 8.505	SEK 5.525.000	SEK 5.000	115,69	—
XS0219808549	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked	0,49	2005	—	08-VI-2020	08-VI	08-VI	103.404	6.229	150.000	1000	100,00	—
XS0220507023	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Floored	1,50	2005	—	22-VI-2020	22-VI	22-VI	89.879	2.483	100.000	1000	100,00	—
XS0222759689	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Floored	1,27	2005	—	15-VII-2020	15-VII	15-VII	34.000	2.867	100.000	1000	100,00	—
XS0222844952	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Targeted Switch	1,18	2005	—	15-VII-2020	15-VII	15-VII	78.379	1.467	100.000	1000	100,00	—
XS0212674575	BEI 2005-2020 Fixed / Index-Linked	0,12	2005	—	16-III-2020	16-III	16-III	100.000	2.969	100.000	1000	100,00	—
XS0233286078	BEI 2005-2025 Fixed / CMS-Linked con Premio al Rimborso	0,92	2005	—	18-XI-2025	18-XI	18-XI	50.000	6.294	50.000	1000	100,00	—
XS0258970051	BEI 2006-2016 14% TRY	14,00	2014	—	05-VII-2016	05-VII	05-VII	TRY 695.000	TRY 116.561	TRY 695.000	TRY 1.000	100,20	—
XS0272359489	BEI 2006-2016 3,875% Earns	3,88	2006	—	15-X-2016	15-X	15-X	5.000.000	6.917	5.000.000	1000	99,42	—
XS0274987873	BEI 2006-2016 4,875% GBP	4,88	2008	—	07-IX-2016	07-IX	07-IX	GBP 1.250.000	GBP 647	GBP 1.250.000	GBP 1.000	100,36	—
US298785DY99	BEI 2006-2016 5,125% USD	5,13	2006	—	13-IX-2016	13-III	13-IX	USD 3.000.000	USD 2.644	USD 3.000.000	USD 1.000	99,72	—
XS0258132272	BEI 2006-2016 Price-Linked	0,00	2006	—	21-VII-2016	21-VII	21-VII	947.526	21.901	1.000.000	1000	100,00	—
US298785DV50	BEI 2006-2036 4,875% USD	4,88	2006	—	15-II-2036	15-II	15-II	USD 1.000.000	USD 12.469	USD 1.000.000	USD 1.000	99,18	—
XS0308505055	BEI 2007-2017 4,75%	4,75	2007	—	15-X-2017	15-X	15-X	5.000.000	3.218	5.000.000	1000	99,87	—
US298785EA05	BEI 2007-2017 4,875% USD	4,88	2007	—	17-I-2017	17-I	17-I	USD 3.000.000	USD 2.346	USD 3.000.000	USD 1.000	99,45	—
US298785EG74	BEI 2007-2017 5,125% USD	5,13	2008	—	30-V-2017	30-V	30-V	USD 3.000.000	USD 1.389	USD 3.000.000	USD 1.000	99,78	—
XS0302736219	BEI 2007-2019 5,375% GBP	5,38	2007	—	07-III-2019	07-III	07-III	GBP 300.000	GBP 520	GBP 3.000.000	GBP 1.000	99,43	—
XS0290050524	BEI 2007-2024 4,125%	4,13	2007	—	15-IV-2024	15-IV	15-IV	3.000.000	5.522	3.000.000	1000	95,90	—
XS0295479983	BEI 2007-2044 4,5% GBP	4,50	2007	—	07-III-2044	07-III	07-III	GBP 735.000	GBP 911	GBP 735.000	GBP 1.000	97,30	—
XS0344863955	BEI 2008-2017 4,25% NOK	4,25	2008	—	19-V-2017	19-V	19-V	NOK 8.050.000	NOK 95.630	NOK 8.050.000	NOK 10.000	95,00	—
XS0434040167	BEI 2009-2017 4,125% GBP	4,13	2009	—	07-XII-2017	07-XII	07-XII	GBP 825.000	GBP 715	GBP 825.000	GBP 1.000	99,27	—
XS0412826579	BEI 2009-2019 4,25%	4,25	2009	—	15-IV-2019	15-IV	15-IV	2.000.000	2.095	2.000.000	1000	100,76	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS0427291751	BEI 2009-2025 4,5% Earns	4,50	2009	—	15-X-2025	15-X	15-X	3.500.000	986	3.500.000	1000	99,64	—
XS0415532273	BEI 2009-2029 4,5% GBP	4,50	2009	—	07-VI-2029	07-VI	07-VI	GBP 955.000	GBP 569	GBP 955.000	GBP 1.000	99,09	—
XS0558939269	BEI 2010-2017 2% USD	2,00	2010	—	15-XII-2017	15-VI	15-XII	USD 1.500.000	USD 12.034	USD 1.500.000	USD 1.000	99,63	—
XS0356222173	BEI 2010-2018 9% ZAR	9,00	2008	—	21-XII-2018	21-XII	21-XII	ZAR 1.500.000	ZAR 425.730	ZAR 1.500.000	ZAR 5.000	95,63	—
XS0484854483	BEI 2010-2019 10,5% TRY	10,50	2010	—	12-III-2019	12-III	12-III	TRY 85.000	TRY 10.887	TRY 85.000	TRY 1.000	103,10	—
US298785FH49	BEI 2010-2020 2,875% USD	2,88	2010	—	15-IX-2020	15-III	15-IX	USD 3.000.000	USD 13.638	USD 3.000.000	USD 1.000	99,85	—
XS0544644957	BEI 2010-2022 3%	3,00	2010	—	28-IX-2022	28-IX	28-IX	1.750.000	2.521	1.750.000	1000	99,66	—
XS0505157965	BEI 2010-2030 4%	4,00	2010	—	15-IV-2030	15-IV	15-IV	3.000.000	1.269	3.000.000	1000	98,70	—
US298785FS04	BEI 2011-2016 1,25% USD	1,25	2011	—	14-X-2016	14-IV	14-X	USD 3.000.000	USD 9.001	USD 3.000.000	USD 1.000	99,95	—
US298785FQ48	BEI 2011-2016 2,125% USD	2,13	2011	—	15-VII-2016	15-I	15-VII	USD 3.000.000	USD 1.963	USD 3.000.000	USD 1.000	99,88	—
XS0630398534	BEI 2011-2016 2,875%	2,88	2011	—	15-VII-2016	15-VII	15-VII	5.000.000	505	5.000.000	1000	99,49	—
XS0677817594	BEI 2011-2016 3% NOK	3,00	2011	—	16-IX-2016	16-IX	16-IX	NOK 2.750.000	NOK 34.020	NOK 2.750.000	NOK 10.000	101,21	—
XS0602217159	BEI 2011-2016 3,25% GBP	3,25	2011	—	07-XII-2016	07-XII	07-XII	GBP 550.000	GBP 1.128	GBP 550.000	GBP 100	99,53	—
XS0698632212	BEI 2011-2017 2,625% SEK	2,63	2011	—	15-III-2017	15-III	15-III	SEK 1.500.000	SEK 9.640	SEK 1.500.000	SEK 10.000	100,91	—
XS0692728511	BEI 2011-2018 2,5%	2,50	2011	—	15-X-2018	15-IV	15-X	3.000.000	2.198	3.000.000	1000	99,83	—
XS0648456167	BEI 2011-2018 9,25% TRY	9,25	2011	—	20-VII-2018	20-VII	20-VII	TRY 100.000	TRY 566.042	TRY 100.000	TRY 1.000	98,58	—
XS0669743246	BEI 2011-2019 2,5%	2,50	2011	—	15-III-2019	15-III	15-III	1.000.000	1.373	1.000.000	1000	99,25	—
XS0676294696	BEI 2011-2021 2,75%	2,75	2011	—	15-IX-2021	15-IX	15-IX	3.000.000	2.530	3.000.000	1000	99,38	—
US298785FM34	BEI 2011-2021 4% USD	4,00	2011	—	16-II-2021	16-II	16-II	USD 2.000.000	USD 17.765	USD 2.000.000	USD 1.000	100,00	—
XS0605996700	BEI 2011-2021 9% ZAR	9,00	2011	—	31-III-2021	31-III	31-III	ZAR 700.000	ZAR 219.720	ZAR 700.000	ZAR 10.000	100,38	—
XS0736113340	BEI 2012-2016 1,875%	1,88	2012	—	15-IX-2016	15-IX	15-IX	750.000	1.390	750.000	100	99,62	—
US298785FZ47	BEI 2012-2017 1% USD	1,00	2012	—	15-XII-2017	15-VI	15-XII	USD 3.000.000	USD 83.982	USD 3.000.000	USD 1.000	99,74	—
US298785FW16	BEI 2012-2017 1,625% USD	1,63	2012	—	15-VI-2017	15-VI	15-VI	USD 3.000.000	USD 3.942	USD 3.000.000	USD 1.000	99,94	—
US298785FU59	BEI 2012-2017 1,75% USD	1,75	2012	—	15-III-2017	15-III	15-III	USD 3.500.000	USD 2.149	USD 3.500.000	USD 1.000	99,55	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
				Primo rimborso	Ultimo rimborso									
XS0858481194	BEI 2012-2017 5,5% TRY	5,50	2014	—	28-XI-2017	28-XI	28-XI	TRY 700.000	TRY 214.626	TRY 700.000	TRY	1.000	100,28	—
XS0821238226	BEI 2012-2019 1,875%	1,88	2012	—	15-X-2019	15-IV	15-X	USD 1.250.000	USD 22.408	USD 1.250.000	USD	1.000	99,86	—
XS0742416380	BEI 2012-2019 2,125% USD	2,13	2012	—	15-III-2019	15-III	15-III	USD 1.500.000	USD 10.218	USD 1.500.000	USD	1.000	99,98	—
XS0824094089	BEI 2012-2019 3% NOK	3,00	2012	—	22-V-2019	22-V	22-V	NOK 2.600.000	NOK 37.750	NOK 2.600.000	NOK	10.000	101,57	—
XS0848049838	BEI 2012-2019 6% ZAR	6,00	2014	—	21-X-2019	21-X	21-X	ZAR 5.500.000	ZAR 1.998.375	ZAR 5.500.000	ZAR	5.000	100,22	—
XS0858366098	BEI 2012-2020 1,375%	1,38	2014	—	15-IX-2020	15-IX	15-IX	2.000.000	1.631	2.000.000		1000	99,15	—
XS0849420905	BEI 2012-2020 2,5% GBP	2,50	2012	—	31-X-2022	31-X	31-X	GBP 500.000	GBP 6.082	GBP 500.000	GBP	100	106,27	—
XS0748631164	BEI 2012-2020 2,625%	2,63	2012	—	16-III-2020	16-III	16-III	1.000.000	1.712	1.000.000		1000	99,54	—
XS0832628423	BEI 2012-2022 2,25%	2,25	2012	—	14-X-2022	14-X	14-X	3.000.000	1.090	3.000.000		1000	98,92	—
XS0852107266	BEI 2012-2023 2,75% SEK	2,75	2012	—	13-XI-2023	13-XI	13-XI	SEK 750.000	SEK 45.100	SEK 750.000	SEK	10.000	100,71	—
XS0807336077	BEI 2012-2025 2,75%	2,75	2012	—	15-IX-2025	15-IX	15-IX	1.600.000	7.904	1.600.000		1000	99,58	—
XS0755873253	BEI 2012-2027 3,5%	3,50	2012	—	15-IV-2027	15-IV	15-IV	4.000.000	890	4.000.000		1000	99,76	—
XS0768478868	BEI 2012-2027 3,75% GBP	3,75	2012	—	07-XII-2027	07-XII	07-XII	GBP 300.000	GBP 2.665	GBP 300.000	GBP	1.000	99,05	—
XS0740808802	BEI 2012-2037 3,875% GBP	3,88	2012	—	08-VI-2037	08-VI	08-VI	GBP 600.000	GBP 1.302	GBP 600.000	GBP	1.000	98,28	—
US298785GD26	BEI 2013-2016 0,5% USD	0,50	2013	—	15-VIII-2016	15-II	15-VIII	USD 5.000.000	USD 15.000	USD 5.000.000	USD	1.000	99,80	—
US298785GE09	BEI 2013-2016 1,125%	1,13	2013	—	15-XII-2016	15-XII	15-XII	USD 3.000.000	USD 9.620	USD 3.000.000	USD	1.000	99,98	—
XS0960889060	BEI 2013-2016 7,625% TRY	7,63	2013	—	28-X-2016	28-X	28-X	TRY 75.000	TRY 5.479	TRY 75.000	TRY	1.000	99,26	—
XS0875891615	BEI 2013-2017 5,375% TRY	5,38	2014	—	23-I-2017	23-I	23-I	TRY 290.000	TRY 36.927	TRY 290.000	TRY	1.000	101,01	—
XS0875343591	BEI 2013-2017 5,75% ZAR	5,75	2013	—	21-XII-2017	21-XII	21-XII	ZAR 2.450.000	ZAR 369.650	ZAR 2.450.000	ZAR	10.000	101,43	—
XS0994434487	BEI 2013-2017 6,75% ZAR	6,75	2014	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	ZAR 1.000.000	ZAR 249.180	ZAR 1.000.000	ZAR	5.000	100,77	—
XS0956262033	BEI 2013-2017 7% TRY	7,00	2013	—	31-VII-2017	31-VII	31-VII	TRY 235.000	TRY 93.458	TRY 235.000	TRY	1.000	99,38	—
XS0878567394	BEI 2013-2018 1%	1,00	2013	—	13-VII-2018	15-VII	13-VII	5.000.000	4.363	5.000.000		1000	99,55	—
US298785GA86	BEI 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	15-III-2018	15-III	15-III	USD 5.000.000	USD 13.414	USD 5.000.000	USD	1.000	99,43	—
US298785GC43	BEI 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	15-VI-2018	15-VI	15-VI	USD 5.000.000	USD 55.523	USD 5.000.000	USD	1.000	99,40	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS0872706881	BEI 2013-2018 1,375% GBP	1,38	2013	—	15-I-2018	15-I	15-I	GBP 1.000.000	GBP 10.139	GBP 1.000.000	GBP 100	99,76	—
US298785GG56	BEI 2013-2018 1,625% USD	1,63	2014	—	18-XII-2018	18-VI	18-XII	USD 3.000.000	USD 18.217	USD 3.000.000	USD 1.000	99,78	—
XS0921767116	BEI 2013-2018 1,75% CAD	1,75	2013	—	24-IV-2018	24-IV	24-IV	CAD 500.000	CAD 9.735	CAD 500.000	CAD 1.000	99,66	—
XS0875329848	BEI 2013-2018 2,5% NOK	2,50	2013	—	17-I-2018	17-I	17-I	NOK 1.600.000	NOK 17.310	NOK 1.600.000	NOK 10.000	101,30	—
XS0935881853	BEI 2013-2018 5,25% TRY	5,25	2014	—	03-IX-2018	03-IX	03-IX	TRY 500.000	TRY 248.081	TRY 500.000	TRY 1.000	100,56	—
XS0877809375	BEI 2013-2018 5,75% TRY	5,75	2014	—	03-IV-2018	03-IV	03-IV	TRY 550.000	TRY 214.531	TRY 550.000	TRY 1.000	101,21	—
XS0881488430	BEI 2013-2019 1,5% GBP	1,50	2013	—	01-II-2019	01-II	01-II	GBP 650.000	GBP 23.473	GBP 650.000	GBP 1.000	99,44	—
XS0957736480	BEI 2013-2019 7,5% ZAR	7,50	2014	—	30-I-2019	30-I	30-I	ZAR 1.550.000	ZAR 299.920	ZAR 1.550.000	ZAR 10.000	99,14	—
XS0995130712	BEI 2013-2019 8,5% TRY	8,50	2014	—	25-VII-2019	25-VII	25-VII	TRY 225.000	TRY 233.248	TRY 225.000	TRY 1.000	101,60	—
XS0903345220	BEI 2013-2020 1,5%	1,50	2013	—	15-VII-2020	15-VII	15-VII	4.000.000	1.879	4.000.000	1000	99,97	—
XS0888089082	BEI 2013-2020 1,625% USD	1,63	2013	—	16-III-2020	16-III	16-III	USD 1.250.000	USD 51.539	USD 1.250.000	USD 1.000	99,20	—
XS0984173624	BEI 2013-2020 7,5% ZAR	7,50	2014	—	15-I-2020	15-I	15-I	ZAR 700.000	ZAR 433.035	ZAR 700.000	ZAR 5.000	101,17	—
XS0918749622	BEI 2013-2021 1,375%	1,38	2014	—	15-IX-2021	15-IX	15-IX	140.000	1.378	140.000	1000	100,00	—
XS0942172296	BEI 2013-2023 2%	2,00	2013	—	14-IV-2023	14-IV	14-IV	4.000.000	4.587	4.000.000	1000	99,98	—
XS0975634204	BEI 2013-2033 3%	3,00	2013	—	14-X-2033	14-X	14-X	3.000.000	2.105	3.000.000	1000	99,57	—
XS0878008225	BEI 2013-2035 2,625%	2,63	2014	—	15-III-2035	15-III	15-III	140.000	1.256	140.000	1000	99,03	—
XS0884635524	BEI 2013-2040 2,75%	2,75	2014	—	15-III-2040	15-III	15-III	170.000	578	170.000	1000	99,62	—
XS1028546916	BEI 2014-2017 0,5%	0,50	2014	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	850.000	2.028	850.000	1000	99,61	—
US298785GK68	BEI 2014-2017 0,875% USD	0,88	2014	—	18-IV-2017	18-IV	18-IV	USD 5.000.000	USD 9.155	USD 5.000.000	USD 1.000	99,90	—
US298785GN08	BEI 2014-2017 1% USD	1,00	2014	—	17-VIII-2017	17-II	17-VIII	USD 3.000.000	USD 8.623	USD 3.000.000	USD 1.000	99,71	—
XS1038294531	BEI 2014-2017 10% TRY	10,00	2014	—	03-III-2017	03-III	03-III	TRY 1.000.000	TRY 61.154	TRY 1.000.000	TRY 1.000	100,29	—
XS1014703851	BEI 2014-2017 10,5% BRL	9,00	2014	—	21-XII-2017	21-XII	21-XII	BRL 1.675.000	BRL 848.740	BRL 1.675.000	BRL 5.000	99,90	—
XS1095747835	BEI 2014-2017 8,625% BRL	8,63	2014	—	29-VIII-2017	29-VIII	29-VIII	BRL 225.000	BRL 35.420	BRL 225.000	BRL 5.000	100,00	—
XS1136802615	BEI 2014-2018 10% BRL	10,00	2014	—	19-VI-2018	19-VI	19-VI	BRL 275.000	BRL 298.510	BRL 275.000	BRL 5.000	100,73	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
XS1107496439	BEI 2014-2018 4,25% NZD	4,25	2014	—	10-IX-2018	10-IX	10-IX	NZD 125.000	NZD 37.186	NZD 125.000	NZD 1.000	101,09	—
XS1041094118	BEI 2014-2018 7,75% ZAR	7,75	2014	—	12-III-2018	12-III	12-III	ZAR 500.000	ZAR 24.420	ZAR 500.000	ZAR 5.000	100,57	—
US298785GM25	BEI 2014-2019 1,75% USD	1,75	2014	—	17-VI-2019	17-VI	17-VI	USD 5.000.000	USD 6.324	USD 5.000.000	USD 1.000	99,58	—
XS1053090665	BEI 2014-2019 10,75% TRY	10,75	2014	—	15-XI-2019	15-XI	15-XI	TRY 100.000	TRY 61.442	TRY 100.000	TRY 1.000	101,41	—
XS1028038096	BEI 2014-2019 2,125% CAD	2,13	2014	—	04-II-2019	04-II	04-II	CAD 1.200.000	CAD 4.192	CAD 1.200.000	CAD 1.000	99,90	—
XS1015120964	BEI 2014-2019 2,25% SEK	2,25	2014	—	12-III-2019	12-III	12-III	SEK 1.750.000	SEK 8.920	SEK 1.750.000	SEK 10.000	99,62	—
XS1017788784	BEI 2014-2019 5% NZD	5,00	2014	—	22-I-2019	22-I	22-I	NZD 125.000	NZD 22.863	NZD 125.000	NZD 1.000	101,02	—
XS1051861851	BEI 2014-2020 2,25% GBP	2,25	2014	—	07-III-2020	07-III	07-III	GBP 500.000	GBP 1.402	GBP 500.000	GBP 1.000	99,60	—
XS1089985557	BEI 2014-2020 4,625% NZD	4,63	2014	—	30-VII-2020	30-VII	30-VII	NZD 100.000	NZD 6.775	NZD 100.000	NZD 1.000	101,01	—
XS1105947714	BEI 2014-2020 7,5% ZAR	7,50	2014	—	10-IX-2020	10-IX	10-IX	ZAR 500.000	ZAR 317.560	ZAR 500.000	ZAR 5.000	96,39	—
XS1139474206	BEI 2014-2020 8% TRY	8,00	2014	—	01-IV-2020	01-IV	01-IV	TRY 1.000.000	TRY 193.831	TRY 1.000.000	TRY 1.000	99,76	—
XS1098105254	BEI 2014-2020 8,75% TRY	8,75	2014	—	06-VII-2020	06-VII	06-VII	TRY 1.000.000	TRY 12.456	TRY 1.000.000	TRY 1.000	101,51	—
US298785GP55	BEI 2014-2021 2,125% USD	2,22	2014	—	15-X-2021	15-IV	15-X	USD 3.000.000	USD 29.363	USD 3.000.000	USD 1.000	99,25	—
US298785GL42	BEI 2014-2021 2,5% USD	2,50	2014	—	15-IV-2021	15-IV	15-IV	USD 3.000.000	USD 5.808	USD 3.000.000	USD 1.000	99,89	—
XS1072624072	BEI 2014-2021 8,25% ZAR	8,25	2014	—	13-IX-2021	13-IX	13-IX	ZAR 900.000	ZAR 384.100	ZAR 900.000	ZAR 5.000	101,07	—
XS1075219763	BEI 2014-2021 8,75% TRY	8,75	2014	—	18-IX-2021	18-IX	18-IX	TRY 200.000	TRY 136.352	TRY 200.000	TRY 1.000	99,82	—
XS1090019370	BEI 2014-2022 8,375% ZAR	8,38	2014	—	29-VII-2022	29-VII	29-VII	ZAR 1.000.000	ZAR 375.790	ZAR 1.000.000	ZAR 5.000	101,60	—
XS1068872925	BEI 2014-2023 1,625%	1,63	2014	—	15-III-2023	15-III	15-III	1.000.000	1.389	1.000.000	1000	99,83	—
XS1059896016	BEI 2014-2024 10,5% TRY	10,50	2014	—	29-IV-2024	29-IV	29-IV	TRY 75.000	TRY 53.532	TRY 75.000	TRY 1.000	100,53	—
XS1023039545	BEI 2014-2024 2,125% EARNs	2,13	2014	—	15-I-2024	15-I	15-I	3.000.000	2.781	3.000.000	1000	99,01	—
US298785GQ39	BEI 2014-2024 2,5% USD	2,50	2014	—	15-X-2024	15-IV	15-X	USD 1.000.000	USD 20.381	USD 1.000.000	USD 1.000	99,18	—
US298785GJ95	BEI 2014-2024 3,25% USD	3,25	2014	—	29-I-2024	29-I	29-I	USD 3.500.000	USD 11.050	USD 3.500.000	USD 1.000	99,62	—
XS1110395933	BEI 2014-2024 8,5% ZAR	8,50	2014	—	17-IX-2024	17-IX	17-IX	ZAR 1.500.000	ZAR 1.221.130	ZAR 1.500.000	ZAR 10.000	98,38	—
XS1115184753	BEI 2014-2024 9,25% TRY	9,25	2014	—	03-X-2024	03-X	03-X	TRY 1.000.000	TRY 176.120	TRY 1.000.000	TRY 1.000	98,74	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
				Primo rimborso	Ultimo rimborso									
XS1107718279	BEI 2014-2026 1,25%	1,25	2014	—	13-XI-2026	13-XI	13-XI	750.000	2.593	750.000	1000	98,74	—	
XS1107247725	BEI 2014-2045 1,75%	1,75	2014	—	15-IX-2045	15-IX	15-IX	500.000	4.273	500.000	1000	97,22	—	
US298785GW07	BEI 2015-2018 1,125% USD	1,13	2015	—	15-VIII-2018	15-II	15-VIII	USD 3.000.000	USD 13.240	USD 3.000.000	USD	1.000	100,00	—
US298785GU41	BEI 2015-2018 1,25% USD	1,25	2015	—	15-V-2018	15-V	15-V	USD 4.000.000	USD 4.228	USD 4.000.000	USD	1.000	99,91	—
XS1250872998	BEI 2015-2018 10% BRL	10,00	2015	—	17-XII-2018	17-XII	17-XII	BRL 100.000	BRL 212.595	BRL 100.000	BRL	5.000	100,63	—
XS1260085037	BEI 2015-2020 0,125% Ecoop	0,13	2015	—	15-VI-2020	15-VI	15-VI	500.000	3.366	500.000	1000	99,50	—	
XS1288040055	BEI 2015-2020 0,25%	0,25	2015	—	15-X-2020	15-X	15-X	3.000.000	2.583	3.000.000	1000	100,00	—	
XS1195588915	BEI 2015-2020 1,125% NOK	1,13	2015	—	15-V-2020	15-V	15-V	NOK 1.500.000	NOK 99.350	NOK 1.500.000	NOK	10.000	101,18	—
US298785GV24	BEI 2015-2020 1,375% USD	1,38	2015	—	15-VI-2020	15-VI	15-VI	USD 5.000.000	USD 52.516	USD 5.000.000	USD	1.000	99,43	—
US298785GR12	BEI 2015-2020 1,625% USD	1,63	2015	—	16-III-2020	16-III	16-III	USD 4.000.000	USD 3.563	USD 4.000.000	USD	1.000	99,75	—
US298785GY62	BEI 2015-2020 1,625% USD	1,63	2015	—	15-XII-2020	15-VI	15-XII	USD 4.000.000	USD 17.717	USD 4.000.000	USD	1.000	99,75	—
XS1190713054	BEI 2015-2020 4% MXN	4,00	2015	—	25-II-2020	25-II	25-II	MXN 1.000.000	MXN 144.181	MXN 1.000.000	MXN	1.000	100,11	—
XS1224031903	BEI 2015-2020 9,125% TRY	9,13	2015	—	07-X-2020	07-X	07-X	TRY 100.000	TRY 105.005	TRY 100.000	TRY	1.000	101,04	—
XS1271698612	BEI 2015-2022 0,375%	0,38	2015	—	15-III-2022	15-III	15-III	500.000	2.509	500.000	1000	99,88	—	
XS1227593933	BEI 2015-2022 1,5% NOK	1,50	2015	—	12-V-2022	12-V	12-V	NOK 1.000.000	NOK 76.950	NOK 1.000.000	NOK	10.000	99,88	—
US298785GX89	BEI 2015-2022 2,25% USD	2,25	2015	—	15-VIII-2022	15-II	15-VIII	USD 3.000.000	USD 13.561	USD 3.000.000	USD	1.000	99,51	—
XS1179347999	BEI 2015-2023 7,25% ZAR	7,25	2015	—	28-II-2023	28-II	28-II	ZAR 500.000	ZAR 176.575	ZAR 500.000	ZAR	5.000	100,55	—
XS1247736793	BEI 2015-2024 0,875%	0,88	2015	—	13-IX-2024	13-IX	13-IX	500.000	1.016	500.000	1000	99,19	—	
XS1207449684	BEI 2015-2025 0,125% Eams	0,13	2015	—	15-IV-2025	15-IV	15-IV	2.000.000	13.323	2.000.000	1000	95,97	—	
US298785GS94	BEI 2015-2025 1,875% USD	1,88	2015	—	10-II-2025	10-II	10-II	USD 3.000.000	USD 88.285	USD 3.000.000	USD	1.000	100,00	—
XS1274823571	BEI 2015-2025 8,75% ZAR	8,75	2015	—	18-VIII-2025	18-VIII	18-VIII	ZAR 500.000	ZAR 226.040	ZAR 500.000	ZAR	5.000	101,03	—
XS1167524922	BEI 2015-2026 8,125% ZAR	8,13	2015	—	21-XII-2026	21-XII	21-XII	ZAR 1.000.000	ZAR 951.615	ZAR 1.000.000	ZAR	5.000	100,52	—
XS1183208328	BEI 2015-2031 1% Ecoop	1,00	2015	—	14-III-2031	14-III	14-III	1.000.000	19.030	1.000.000	1000	99,85	—	
US298785HE99	BEI 2016-2019 1,125% USD	1,13	2016	—	15-VIII-2019	15-II	15-VIII	USD 3.000.000	USD 1.009	USD 3.000.000	USD	1.000	99,98	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
				Primo rimborso	Ultimo rimborso									
US298785HB50	BEI 2016-2019 1,25% USD	1,25	2016	—	15-V-2019	15-V	15-V	USD 4.000.000	USD 3.779	USD 4.000.000	USD	1.000	99,81	—
XS1374123732	BEI 2016-2019 11,5% BRL	11,50	2016	—	11-III-2019	11-III	11-III	BRL 150.000	BRL 27.815	BRL 150.000	BRL	5.000	99,28	—
XS1347819390	BEI 2016-2019 12% BRL	12,00	2016	—	27-VI-2019	27-VI	27-VI	BRL 100.000	BRL 30.460	BRL 100.000	BRL	5.000	99,28	—
XS1386404427	BEI 2016-2019 8,5% ZAR	8,50	2016	—	14-VI-2019	14-VI	14-VI	ZAR 1.000.000	ZAR 33.535	ZAR 1.000.000	ZAR	5.000	100,75	—
XS1416470323	BEI 2016-2021 1,125% GBP	1,13	2016	—	07-IX-2021	07-IX	07-IX	GBP 1.000.000	GBP 1.031	GBP 1.000.000	GBP	1.000	99,39	—
US298785HC34	BEI 2016-2021 1,625% USD	1,63	2016	—	15-VI-2021	15-VI	15-VI	USD 3.500.000	USD 3.778	USD 3.500.000	USD	1.000	100,00	—
US298785HA77	BEI 2016-2021 2% USD	2,00	2016	—	15-III-2021	15-III	15-III	USD 4.500.000	USD 2.998	USD 4.500.000	USD	1.000	99,80	—
XS1394055872	BEI 2016-2026 0,375% Earns	0,38	2016	—	14-IV-2026	14-IV	14-IV	5.000.000	560	5.000.000		1000	100,00	—
US298785HD17	BEI 2016-2026 2,125% USD	2,13	2016	—	13-IV-2026	13-IV	13-IV	USD 1.500.000	USD 1.085	USD 1.500.000	USD	1.000	100,00	—
XS1398573136	BEI 2016-2026 Callable Step-Up Fixed Rate ¹⁾	1,10	2016	—	31-V-2026	31-V	31-V	USD 204.000	USD 12.518	USD 204.000	USD	2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 31-V-2018, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
XS1361554584	BEI 2016-2036 1,125%	1,13	2016	—	15-IX-2036	15-IX	15-IX	500.000	4.369	500.000		1000	97,98	—
XS0074789339	BERS 1997-2017 Zero Coupon ZAR	—	1997	—	07-IV-2017	—	07-IV	ZAR 1.184.520	ZAR 42.010	ZAR 1.184.520	ZAR	5.000	7,10	—
XS0080713497	BERS 1997-2027 Zero Coupon ZAR	—	1997	—	30-XII-2027	—	30-XII	ZAR 3.000.000	ZAR 52.950	ZAR 3.000.000	ZAR	50.000	3,31	—
IT0006526153	BERS 1998-2018 Step-Down Lifestyle	0,00	1998	—	18-XII-2018	18-XII	18-XII	64.717	3.254	77.468		5000000	100,00	—
XS0085289428	BERS 1998-2020 Zero Coupon ZAR	—	1998	—	31-XII-2020	—	31-XII	ZAR 911.800	ZAR 19.950	ZAR 911.800	ZAR	50.000	7,17	—
IT0006527078	BERS 1999-2024 Step-Down Lifestyle	0,00	1999	—	05-II-2024	05-II	05-II	150.000	2.519	150.000		1000	100,00	—
IT0006527524	BERS 1999-2024 Step-Down Mirror con Premio Euribor	0,00	1999	—	05-III-2024	05-III	05-III	50.000	550	50.000		1000	100,00	—
IT0006592981	BERS 2005-2025 CMS-Linked Global Floor	1,20	2005	—	22-VII-2025	22-VII	22-VII	74.000	13.640	75.000		1000	100,00	—
US29874QCF90	BERS 2012-2017 0,75% USD	0,75	2012	—	01-IX-2017	01-III	01-IX	USD 1.700.000	USD 2.648	USD 1.700.000	USD	1.000	99,57	—
US29874QCE26	BERS 2012-2017 1% USD	1,00	2012	—	16-II-2017	16-II	16-II	USD 3.000.000	USD 1.090	USD 3.000.000	USD	1.000	99,40	—
XS0975105395	BERS 2013-2016 9% BRL	9,00	2013	—	30-IX-2016	30-IX	30-IX	BRL 575.000	BRL 32.990	BRL 575.000	BRL	1.000	101,19	—
XS0894522795	BERS 2013-2017 5,25% TRY	5,25	2013	—	28-II-2017	28-II	28-II	TRY 130.000	TRY 6.949	TRY 130.000	TRY	1.000	101,23	—
US29874QCJ13	BERS 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	15-VI-2018	15-VI	15-VI	USD 1.000.000	USD 1.703	USD 1.000.000	USD	1.000	99,93	—

1) Cedole fisse crescenti rispettivamente pari al 1,10%, 1,20%, 1,20%, 1,50%, 1,50%, 1,50%, 1,80%, 1,80%, 2,50% e 2,50%.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso	
				Primo rimborso	Ultimo rimborso									
US29874QCK85	BERS 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	17-IX-2018	17-III	17-IX	USD 1.250.000	USD 1.150	USD 1.250.000	USD	1.000	99,91	—
US29874QCH56	BERS 2013-2020 1,5% USD	1,50	2013	—	16-III-2020	16-III	16-III	USD 1.425.000	USD 8.206	USD 1.425.000	USD	1.000	99,50	—
XS0978719572	BERS 2014-2018 8% TRY	8,00	2013	—	11-X-2018	11-X	11-X	TRY 175.000	TRY 25.356	TRY 175.000	TRY	1.000	101,23	—
US29874QCP72	BERS 2014-2019 1,75% USD	1,75	2014	—	14-VI-2019	14-VI	14-VI	USD 1.500.000	USD 623	USD 1.500.000	USD	1.000	99,54	—
US29874QCR39	BERS 2014-2019 1,75% USD	1,75	2014	—	26-XI-2019	26-V	26-XI	USD 1.650.000	USD 779	USD 1.650.000	USD	1.000	99,90	—
US29874QCT94	BERS 2015-2022 1,875% USD	1,88	2015	—	23-II-2022	23-II	23-II	USD 1.000.000	USD 1.528	USD 1.000.000	USD	1.000	99,73	—
US459058EV16	BIRS 2016-2019 1,25% USD	1,25	2016	—	26-VII-2019	26-I	26-VII	USD 4.500.000	USD 1.865	USD 4.500.000	USD	1.000	99,52	—
US459058FA69	BIRS 2016-2020 1,375% USD	1,38	2016	—	30-III-2020	30-III	30-III	USD 3.000.000	USD 1.403	USD 3.000.000	USD	1.000	99,67	—
US459058FF56	BIRS 2016-2023 1,75% USD	1,75	2016	—	19-IV-2023	19-IV	19-IV	USD 1.000.000	USD 1.115	USD 1.000.000	USD	1.000	99,99	—
XS1365236196	BIRS 2016-2026 1,75% USD Callable	1,75	2016	—	29-III-2026	29-III	29-III	USD 195.000	USD 43.680	USD 195.000	USD	2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato, con preavviso di almeno 5 giorni, in corrispondenza del 29-III di ogni anno a partire dal 29-III-2018.
XS1410230806	BIRS 2016-2026 Tasso Misto USD	2,35	2016	—	28-VI-2026	28-VI	28-VI	USD 120.000	USD 2.022	USD 120.000	USD	2.000	100,00	—
IT0006527516	Council of Europe Development Bank 1999-2019 Step-Down Premio Fisso al Rimborso	0,00	1999	—	15-III-2019	15-III	15-III	90.000	2.275	90.000	1000	100,00	—	
IT0006527185	Council of Europe Development Bank 1999-2024 Step-Down Premio Fisso al Rimborso	0,00	1999	—	26-II-2024	26-II	26-II	125.000	1.662	125.000	1000	100,00	—	
IT0006596909	Council of Europe Development Bank 2005-2025 Flippable CMS-Linked	0,27	2005	—	17-X-2025	17-X	17-X	50.000	5.517	50.000	1000	100,00	—	
EU000A1G0AA6	EFSF 2011-2016 2,75%	2,28	2011	—	18-VII-2016	18-VII	18-VII	5.000.000	933	5.000.000	1000	99,30	—	
EU000A1G0AB4	EFSF 2011-2021 3,375%	3,38	2011	—	05-VII-2021	05-VII	05-VII	5.000.000	831	5.000.000	1000	99,01	—	
EU000A1G0AD0	EFSF 2011-2022 3,5%	3,50	2011	—	04-II-2022	04-II	04-II	3.000.000	701	3.000.000	1000	99,22	—	
EU000A1G0A24	EFSF 2012-2017 1,125%	1,13	2012	—	30-XI-2017	30-XI	30-XI	5.900.000	1.601	5.900.000	1000	99,42	—	
EU000A1G0AU4	EFSF 2012-2017 1,625%	1,63	2012	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	6.000.000	541	6.000.000	1000	99,87	—	
EU000A1G0AR0	EFSF 2012-2019 2,625%	2,63	2012	—	02-V-2019	02-V	02-V	3.000.000	12.248	3.000.000	1000	99,82	—	
EU000A1G0A99	EFSF 2013-2018 1,25%	1,25	2013	—	05-II-2018	05-II	05-II	5.000.000	5.606	5.000.000	1000	99,54	—	

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
EU000A1G0BH9	EFSF 2013-2018 1,25%	1,25	2013	—	31-VII-2018	31-VII	31-VII	4.000.000	854	4.000.000	1000	99,61	—
EU000A1G0A81	EFSF 2013-2020 1,5%	1,50	2013	—	22-I-2020	22-I	22-I	6.000.000	588	6.000.000	1000	99,26	—
EU000A1G0BM9	EFSF 2014-2019 1,25%	1,25	2014	—	22-I-2019	22-I	22-I	8.000.000	841	8.000.000	1000	99,87	—
EU000A1G0BP2	EFSF 2014-2021 1,375%	1,38	2014	—	07-VI-2021	07-VI	07-VI	5.000.000	726	5.000.000	1000	99,19	—
EU000A1G0BN7	EFSF 2014-2024 2,125%	4,22	2014	—	19-II-2024	19-II	19-II	4.000.000	1.851	4.000.000	1000	99,78	—
EU000A1G0DE2	EFSF 2015-2025 0,2%	0,20	2015	—	28-IV-2025	28-IV	28-IV	3.000.000	526	3.000.000	1000	99,62	—
EU000A1G0DD4	EFSF 2015-2045 1,2%	1,20	2015	—	17-II-2045	17-II	17-II	1.500.000	21.435	1.500.000	1000	99,28	—
EU000A1GVJX6	European Union 2011-2021 2,75%	2,75	2011	—	21-IX-2021	21-IX	21-IX	5.000.000	828	5.000.000	1000	99,95	—
EU000A1G4DN5	European Union 2012-2022 2,75%	2,75	2012	—	04-IV-2022	04-IV	04-IV	2.700.000	3.307	2.700.000	1000	99,63	—
EU000A1ZE225	European Union 2014-2024 1,875%	1,88	2014	—	04-IV-2024	04-IV	04-IV	2.600.000	920	2.600.000	1000	99,60	—
EU000A1U9829	ESM 2014-2019 0,875%	0,88	2014	—	15-X-2019	15-X	15-X	3.000.000	550	3.000.000	0,01	99,39	—
EU000A1U9811	ESM 2014-2021 1,375%	1,38	2014	—	04-III-2021	04-III	04-III	6.000.000	502	6.000.000	1000	99,08	—
XS1020293210	IFC 2014-2017 3,25% MXN	3,25	2014	—	23-I-2017	23-I	23-I	MXN 00.000	MXN 34.600	MXN 300.000	MXN 10.000	99,48	—
XS1313203298	IFC 2015-2020 11,5% BRL	11,50	2015	—	30-X-2020	30-X	30-X	BRL 200.000	BRL 9.920	BRL 200.000	BRL 5.000	97,38	—
IT0006526302	Inter-American Development Bank 1998-2018 Reset	7,50	1998	—	24-XII-2018	24-XII	24-XII	77.469	504	77.469	5000000	100,00	—
IT0006525742	Inter-American Development Bank 1998-2018 Reverse Floater Capped	5,50	1998	—	06-XI-2018	06-XI	06-XI	129.114	2.696	129.114	5000000	100,00	—
IT0006596701	World Bank 2005-2025 CMS-Linked Global Floor	0,98	2005	—	07-X-2025	07-X	07-X	75.000	11.013	75.000	1000	100,00	—
US459058BS14	World Bank 2011-2016 1% USD	1,00	2011	—	15-IX-2016	15-III	15-IX	USD 3.550.000	USD 2.376	USD 3.550.000	USD 1.000	100,12	—
US459058CG66	World Bank 2012-2017 0,875% USD	0,88	2012	—	17-IV-2017	17-IV	17-IV	USD 5.100.000	USD 40.984	USD 5.100.000	USD 1.000	99,85	—
XS0902317071	World Bank 2013-2016 6% BRL	6,00	2013	—	15-IX-2016	15-IX	15-IX	BRL 300.000	BRL 38.190	BRL 300.000	BRL 5.000	99,74	—
US459058CY72	World Bank 2013-2023 2,125% USD	2,13	2013	—	13-II-2023	13-II	13-II	USD 750.000	USD 5.699	USD 750.000	USD 1.000	99,42	—
US459058DS95	World Bank 2014-2016 0,625% USD	0,63	2014	—	14-X-2016	14-IV	14-X	USD 2.250.000	USD 1.453	USD 2.250.000	USD 1.000	99,85	—
US459058DN09	World Bank 2014-2018 1,375% USD	1,38	2014	—	10-IV-2018	10-IV	10-IV	USD 3.300.000	USD 931	USD 3.300.000	USD 1.000	99,62	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
				Primo rimborso	Ultimo rimborso								
US459058DL43	World Bank 2014-2019 1,875% USD	1,88	2014	—	15-III-2019	15-III	15-III	USD 4.000.000	USD 837	USD 4.000.000	USD 1.000	99,69	—
US459058DW08	World Bank 2014-2019 1,875% USD	1,88	2014	—	07-X-2019	07-IV	07-X	USD 4.000.000	USD 2.478	USD 4.000.000	USD 1.000	99,85	—
US459058DT78	World Bank 2014-2021 2,25% USD	2,25	2014	—	24-VI-2021	24-VI	24-VI	USD 2.000.000	USD 1.885	USD 2.000.000	USD 1.000	99,39	—
US459058EM17	World Bank 2015-2017 1% USD	1,00	2015	—	15-XI-2017	15-V	15-XI	USD 3.500.000	USD 1.282	USD 3.500.000	USD 1.000	100,00	—
US459058EJ87	World Bank 2015-2018 1% USD	1,00	2015	—	15-VI-2018	15-VI	15-VI	USD 5.000.000	USD 2.164	USD 5.000.000	USD 1.000	99,83	—
US459058ER04	World Bank 2015-2018 1% USD	1,00	2015	—	05-X-2018	05-IV	05-X	USD 4.000.000	USD 3.897	USD 4.000.000	USD 1.000	99,83	—
US459058DY63	World Bank 2015-2022 1,625% USD	1,63	2015	—	10-II-2022	10-II	10-II	USD 4.000.000	USD 5.682	USD 4.000.000	USD 1.000	99,87	—
US459058ES86	World Bank 2015-2022 1,875% USD	1,88	2015	—	07-X-2022	07-IV	07-X	USD 1.250.000	USD 3.099	USD 1.250.000	USD 1.000	99,88	—
XS1198022706	World Bank 2015-2022 8,25% TRY	8,25	2015	—	04-III-2022	04-III	04-III	TRY 50.000	TRY 3.433	TRY 50.000	TRY 1.000	98,72	—
XS1233613188	World Bank 2015-2023 linked to the Ethical Europe Equity Index ¹⁾	1,75	2015	—	05-VII-2023	29-VI	05-VII	USD 83.540	USD 13.580	USD 83.540	USD 2.000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
US45905URL07	World Bank 2015-2025 2,125% USD	2,13	2015	—	03-III-2025	03-III	03-III	USD 600.000	USD 6.673	USD 600.000	USD 1.000	99,11	—
US459058EP48	World Bank 2015-2025 2,5% USD	2,50	2015	—	29-VII-2025	29-I	29-VII	USD 3.500.000	USD 1.590	USD 3.500.000	USD 1.000	99,69	—

¹⁾ Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari all'1,75%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016
AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data ultimo rimborso	Scadenza cedole	Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2015 al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Modalità di conversione	Note sulle modalità di rimborso
	CONVERTIBILI IN AZIONI										
IT0004982770	CHL 2014-2018 6% Convertibile Amortizing ¹⁾	6,00	2014	30-VI-2018	30-VI	4.091	1.776	10.228	0,2	x obbl. : x obbl. : (quota V.N. in scadenza delle obbl. detenute/media aritmetica ponderata per i rispettivi quantitativi trattati dei prezzi ufficiali delle azioni CHL, calcolata nel periodo compreso tra il 14° e 5°, compreso, giorno di Borsa aperta antecedenti l'inizio del periodo di conversione, applicando uno sconto del 20%.	Rimborso in 5 rate annuali uguali esigibili a partire dal 30-VI-2014.
IT0003872394	SIAS 2005-2017 2,625% Convertibile ²⁾	2,63	2005	30-VI-2017	01-I	334.609	10.292	334.688	10,5	1 obbl. : 1 az.	—

1) Convertibile fino al 31-V-2017. - 2) Convertibile fino al 22-VI-2018.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
DI STATO		
IT0004584204	C.C.T 2010-2017 em. 1-3-10	Interessi semestrali pari al rendimento lordo dei Buoni Ordinari del Tesoro a 6 mesi (arrotondato allo 0,05% più vicino per i titoli emessi fino al 29-12-2005; arrotondato allo 0,01% più vicino per i successivi) moltiplicato per il rapporto tra 180 ed il numero di giorni effettivi di durata dei BOT più una maggiorazione dello 0,15%. Parametri di indicizzazione rilevati nelle aste della fine del mese precedente l'inizio del godimento della cedola.
IT0004874399	C.C.T 2012-2016 em. 1-12-12	Interessi semestrali pari al 3%. Titoli assegnati ai titolari di crediti commerciali, ai sensi dell'articolo 35 del decreto legge 24 gennaio 2012, n. 1, convertito, con modificazioni, dalla legge 24 marzo 2012, n. 27.
IT0004652175	C.C.T.eu 2010-2017 em. 27-X-10	Interessi semestrali pari all'Euribor a 6 mesi maggiorato, rispettivamente, dello 0,8% per i primi due ed il settimo titoli, dell'1% per il terzo, del 2,5% per il quarto titolo, 2,1% per il quinto titolo, 1,2% per il sesto titolo, e 0,55% per il settimo titolo e 0,7% per l'ottavo e il nono, calcolati contando i giorni effettivi del semestre di riferimento sulla base dell'anno commerciale con arrotondamento al terzo decimale. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004716319	» 2011-2018 em. 2-V-11	
IT0004809809	» 2011-2017 em. 15-XII-11	
IT0004922909	» 2013-2018 em. 1-V-13	
IT0005009839	» 2013-2019 em. 1-IV-14	
IT0005056541	» 2014-2020 em. 1-X-14	
IT0005104473	» 2014-2022 em. 15-XII-14	
IT0005137614	» 2015-2022 em. 15-VI-15	
IT0005185456	» 2016-2023 em. 2-V-16	
IT0003745541	BTPei 2004-2035 2,35%	
IT0004085210	» 2006-2017 2,10%	
IT0004243512	» 2007-2023 2,60%	
IT0004380546	» 2008-2019 2,35%	
IT0004604671	» 2010-2021 2,10%	
IT0004682107	» 2011-2016 2,10%	
IT0004735152	» 2011-2026 3,10%	
IT0004890882	» 2013-2018 1,70%	
IT0005004426	» 2014-2024 2,35%	
IT0005138828	» 2015-2032 1,25%	
IT0004863608	BTP Italia 2012-2016 2,55%	Interessi semestrali indicati rispettivamente pari al 2,45%, 3,55%, 2,55%, 2,25%, 2,15%, 1,65%, 1,25%, 0,50%, 0,40% e 0,10% su base annua. Il rimborso del capitale e il pagamento degli interessi sono indicizzati all'indice ISTAT sui prezzi al consumo per famiglie di operai e impiegati (FOI) con esclusione dei tabacchi. Premio a scadenza pari al 4 per mille sul capitale nominale investito non rivalutato in caso di detenzione del titolo a partire dai giorni di emissione fino a scadenza (c.d. "Premio fedeltà).
IT0004917958	» 2013-2017 2,25%	
IT0004969207	» 2013-2017 2,15%	
IT0005012783	» 2014-2020 1,65%	
IT0005105843	» 2015-2023 0,50%	
IT0005174906	» 2016-2024 0,40%	
IT0005188120	» 2016-2022 0,10%	

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS0100688190	Republic of Italy 1999-2019 Euro CMS	Interessi annuali pari al tasso Swap Euribor a 30 anni, diminuito dello 0,91%. Parametri di indicizzazione rilevati il secondo giorno lavorativo precedente la data di godimento della cedola.
XS0098449456	Republic of Italy 1999-2029 CMS 30Y con Floor 4,25%	Interessi annuali pari all'80% del tasso Swap Euribor a 30 anni. Parametri di indicizzazione rilevati il secondo giorno lavorativo precedente la data di godimento della cedola. Nessuna cedola potrà assumere valore inferiore al 4,25%.
ES00000126W8	Bonosei 2013-2019 0,55%	Interessi annuali pari allo 0,55% del coefficiente di indicizzazione, calcolato come variazione dell'indice armonizzato dei prezzi al consumo per l'area Euro (escluso il tabacco) tra la data di godimento del titolo e la data di pagamento della cedola. Il rimborso del capitale è pari al prodotto tra il valore nominale e il coefficiente di indicizzazione.
DE0001030542	Bund 2003-2023 0,1%	In aggiunta alla cedola fissa, pari allo 0,1% interessi annuali pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro mensile. Premio al rimborso pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro mensile.
DE0001030559	Bundei 2014-2030 0,5%	Interessi annuali pari allo 0,5% del coefficiente di indicizzazione, calcolato come variazione dell'indice armonizzato dei prezzi al consumo per l'area Euro (escluso il tabacco) tra la data di godimento del titolo e la data di pagamento della cedola. Il rimborso del capitale è pari al prodotto tra il valore nominale e il coefficiente di indicizzazione.
DE0001030526	Federal Republic of Germany 2009-2020 Inflation-linked Bonds	In aggiunta alla cedola fissa, pari all'1,75% interessi annuali pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro mensile. Premio al rimborso pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro mensile.
DE0001030534	Federal Republic of Germany 2011-2018 Inflation-linked Bonds	In aggiunta alla cedola fissa, pari allo 0,75% interessi annuali pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro mensile. Premio al rimborso pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro mensile.
FR0010050559	OATei 2003-2020 2,25%	Interessi annuali pari rispettivamente al 3,15%, 2,25%, 1,8%, 1,1%, 0,25% e 0,7% del coefficiente di indicizzazione, calcolato come la somma del valore dell'indice armonizzato dei prezzi al consumo per l'area Euro (escluso il tabacco), del terzo mese antecedente quello di godimento e del prodotto tra il rapporto del numero dei giorni del mese di godimento meno uno e il numero dei giorni del terzo mese antecedente e la differenza tra l'indice del terzo mese antecedente e quello del secondo antecedente. Il rimborso del capitale è pari al prodotto tra il valore nominale e il coefficiente di indicizzazione.
FR0010447367	» 2006-2040 1,8%	
FR0010899765	» 2009-2022 1,1%	
FR0011982776	» 2013-2030 0,7%	

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
FR0010235176 FR0000186413 FR0010585901	OATi 2005-2017 1% » 1999-2029 3,4% » 2007-2023 2,1%	Interessi annuali pari rispettivamente al 3,4%, 1%, 3,4%, 2,1% e 1,3% del coefficiente di indicizzazione, calcolato come la somma del valore dell'indice dei prezzi al consumo escluso il tabacco per le famiglie residenti in Francia (pubblicato dall'INSEE) del terzo mese antecedente quello di godimento e del prodotto tra il rapporto del numero dei giorni del mese di godimento meno uno e il numero dei giorni del terzo mese antecedente e la differenza tra l'indice del terzo mese antecedente e quello del secondo antecedente. Il rimborso del capitale è pari al prodotto tra il valore nominale e il coefficiente di indicizzazione.
ES00000126A4	Obligaciones 2013-2024 1,8%	Interessi annuali pari all'1,8% del coefficiente di indicizzazione, calcolato come variazione dell'indice armonizzato dei prezzi al consumo per l'area Euro (escluso il tabacco) tra la data di godimento del titolo e la data di pagamento della cedola. Il rimborso del capitale è pari al prodotto tra il valore nominale e il coefficiente di indicizzazione.
IT0006592080	Republic of Austria 2005-2022 CMS-Linked Flippable con Floor	A partire dalla quarta cedola, interessi annuali pari a quattro volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni. Dal 22-VI-2008, l'emittente ha la facoltà di trasformare la modalità di indicizzazione e la cadenza degli interessi. In caso di trasformazione, interessi semestrali pari all'Euribor a 6 mesi maggiorato dello 0,25%; dal 19-VI-2012 la modalità di calcolo dei ratei è diventata ACT/360.
XS0216258763	Republic of Austria 2005-2020 CMS Spread Floater Notes	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi, maggiorato dello 0,7% su base annua, qualora nel periodo di riferimento il tasso Swap Euro a 10 anni sia superiore a quello a 2 anni. In caso contrario la cedola sarà nulla. Parametri di indicizzazione rilevati due giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola. Premio a scadenza non negativo pari alla differenza tra il 30% e la somma di tutte le cedole pagate precedentemente.
XS0221500571	Republic of Austria 2005-2020 FRN	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi, maggiorato dell'1% su base annua, rilevato due giorni lavorativi antecedenti la data di godimento della cedola. Gli interessi su base annua non potranno superare sette volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni. Premio a scadenza non negativo pari alla differenza tra il 30% e la somma di tutte le cedole pagate precedentemente.
XS0224713254	Republic of Austria 2005-2025 CMS-Linked	Interessi semestrali pari al maggiore tra l'1% e il tasso Swap Euro a 10 anni, qualora nel periodo di riferimento la differenza tra il tasso Swap Euro a 30 anni e quello a 2 anni superi lo 0,5%. In caso contrario, la cedola sarà pari all'1%. Parametri di indicizzazione rilevati due giorni lavorativi precedenti la data del godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS0229808315	Republic of Austria 2005-2025 CMS Spread-Linked	A partire dalla quinta cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi, maggiorato dell'1,5% su base annua, qualora nel periodo di riferimento il quintuplo della differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni sia superiore all'Euribor a 6 mesi. In caso contrario la cedola sarà nulla. Parametri di indicizzazione rilevati due giorni lavorativi precedenti la data del godimento della cedola. Premio a scadenza non negativo pari alla differenza tra il 40% e la somma di tutte le cedole pagate precedentemente.
XS0231558858	Republic of Austria 2005-2035 Fixed to CMS-Linked	A partire dalla data di godimento del 24-X-2010 interessi annuali variabili pari al quadruplo della differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni. Gli interessi non potranno superare il 7% annuo. A partire dal 24-X-2010 l'emittente ha la facoltà di trasformare la modalità di indicizzazione delle cedole; in tal caso, gli interessi saranno pari al tasso Euribor a 12 mesi maggiorato dello 0,25%. Premio a scadenza non negativo pari all'eventuale differenza tra il 60% e la somma delle cedole pagate precedentemente.
DI ENTI E SOCIETÀ		
IT0001330411	Banca Carige 1999-2019 Indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni con Floor 4%	Interessi annuali pari all'82,5% del tasso Swap Euro a 10 anni, arrotondato allo 0,01% più vicino. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola. Cedola annuale minima pari al 4%.
IT0004648694	Banca IMI 2010-2017 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004694086	Banca IMI 2011-2017 Tasso Misto	Undicesima e dodicesima cedola pari all'Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004906308	Banca IMI 2013-2019 Tasso Misto Cap&-Floor	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2%, con <i>floor</i> 2% e <i>cap</i> 4,6% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004966229	Banca IMI 2013-2020 Collezione Opportunità USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0005001422	Banca IMI 2014-2019 Collezione Tasso Misto Serie I USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,21%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005114365	Banca IMI 2015-2022 Collezione Tasso Misto Serie II USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,50%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005001521	Banca IMI 2014-2019 Collezione Tasso Misto Serie I NZD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso NZD BB (Bank Bills) a 3 mesi più uno <i>spread</i> dello 0,75%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005114357	Banca IMI 2015-2022 Collezione Tasso Misto Serie I GBP	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/365 più uno <i>spread</i> dello 0,50%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1341083555	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto Serie I	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,75%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1341083639	Banca IMI 2016-2023 Collezione Tasso Misto Serie III USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1378969072	Banca IMI 2016-2024 Collezione Tasso Misto Serie IV USD	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,3% con <i>cap</i> 4% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1379091546	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto Serie II	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,6% con <i>cap</i> 2,20% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004739576	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor BancoPosta	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,2% con <i>cap</i> 5,5% e <i>floor</i> 4,4% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0004761356	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor BancoPosta	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,4% con <i>cap</i> 5,4% e <i>floor</i> 4,6% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0236480322	Banca Monte dei Paschi di Siena 2005-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0238916620	Banca Monte dei Paschi di Siena 2005-2018 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004703317	Banco Popolare 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Euribor a 6 mesi più uno <i>spread</i> dell'1,15%, con <i>floor</i> 4,25% e <i>cap</i> 6% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004723893	Banco Popolare 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor BancoPosta Serie 2	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi più uno <i>spread</i> dell'1% con <i>floor</i> 4% e <i>cap</i> 5,6% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005120313	Banco Popolare 2015-2022 Tier2 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 4,375%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005090995	CDP 2015-2022 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola. Qualora il valore sia negativo le cedole sono nulle.
IT0001267381	Centrobanca 1998-2018 Reverse Floater Capped	Dalla quinta cedola interessi annuali pari alla differenza (arrotondata allo 0,01% più vicino) tra 14,5% ed il doppio del tasso Libor sull'Euro a 12 mesi (quest'ultimo moltiplicato per 365/360). Le cedole pagabili dal 20 ottobre 2009 fino a scadenza non possono assumere valore negativo o essere superiori al 5,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001312708	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Eurostability Bond	Premio al rimborso pari al: - 60% del valore nominale qualora, per ogni cedola, la media aritmetica dei tassi Swap Euribor a 10 anni rilevati nei 5 giorni antecedenti la data di godimento della cedola sia sempre inferiore al 4,75%;

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0001312708	(segue)	- 25% del valore nominale qualora la suddetta media sia almeno una volta superiore al 4,75%.
IT0001300992	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro a 10 Anni	Dalla sesta cedola interessi annuali pari al 70% del tasso Swap Euribor a 10 anni (arrotondato allo 0,01% più vicino). Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004803158	Credem 2012-2018 Tasso Misto Amortizing	Dalla seconda cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004819006	Credem 2012-2018 Tasso Misto Amortizing	Dalla seconda cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 4,45%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001264792	Crediop 1998-2018 T.F./Capped Reverse Floater	Dalla sesta cedola interessi annuali pari alla differenza (arrotondata allo 0,01% più vicino) tra il 14,5% ed il doppio del tasso Libor sull'Euro a 12 mesi (quest'ultimo moltiplicato per 365/360). Le cedole non possono essere superiori al 5,5% o assumere valore negativo. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001277406	Crediop 1998-2018 T.F./Capped Reverse Floater	Dall'ottava cedola interessi annuali pari alla differenza (arrotondata allo 0,01% più vicino) tra il 13,1% ed il doppio della media aritmetica dei tassi: - Libor sull'Euro 12 mesi; - Libor sullo Yen 12 mesi; - Libor sul Dollaro statunitense 12 mesi. Le cedole non possono essere superiori al 5,5% o assumere valore negativo. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001317707	Crediop 1999-2019 Step-Down Lifestyle Accrued Interest	Interessi pagabili alla scadenza pari all'1% del valore nominale delle obbligazioni per ogni anno in cui, a partire dal sesto fino al 29 marzo 2018, il tasso Swap Euribor a 10 anni risulti superiore al 5,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente il 29 marzo di ogni anno dal 2004 fino al 2018. Il premio non potrà essere superiore al 15%.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0001303350	Crediop 1999-2019 T.F./Capped Reverse Floater	Dall'undicesima cedola interessi annuali pari alla differenza (arrotondata allo 0,01% più vicino) tra il 14% ed il doppio del tasso Libor sull'Euro a 12 mesi (quest'ultimo moltiplicato per 365/360). Le cedole pagabili dal 29 gennaio 2006 fino a scadenza non possono assumere valore negativo o essere superiori al 5%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0550715600	Dexia Crediop 2010-2018 4,25% Trasformabile	Dal 22-X-2014 eventuali interessi trimestrali pari all'Euribor a 3 mesi maggiorato dello 0,4% annuo, con un preavviso di almeno 5 giorni lavorativi. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0557268173	Dexia Crediop 2010-2020 Serie Speciale n.3 Reverse Floater	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al 5,25% meno l'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004794159	Enel 2012-2018 Tasso Variabile	Dalla quinta cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 3,1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004760648	Eni 2011-2017 Tasso Variabile	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2,8%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001311247	Interbanca 1999-2019 Upside Protected	Dalla sesta cedola interessi annuali (arrotondati allo 0,01% più vicino) pari al 120% della differenza tra il tasso Swap a 10 anni (contro Euribor a 6 mesi) e il 5,7%. Nessuna cedola potrà assumere valore negativo. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001304010	Interbanca 1999-2021 Coupon Reset	Dalla decima alla dodicesima cedola interessi annuali pari al 4,15% qualora la media aritmetica, arrotondata allo 0,01% più vicino, delle nove rilevazioni relative al quinto giorno lavorativo antecedente la data di godimento di ciascuna delle prime nove cedole risulti pari o inferiore al 4%. In caso contrario l'interesse di ciascuna delle tre cedole sarà nullo.
XS0213927667	Intesa Sanpaolo 2005-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,2%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS1057822766	Intesa Sanpaolo 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,05%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1246144650	Intesa Sanpaolo 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,05%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001339586	Mediobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro 30 Anni	Dopo la sesta cedola interessi annuali pari al 67% del tasso Swap Euro a 30 anni, quotazione mid-market, con riferimento all'Euribor a 6 mesi (arrotondato allo 0,01% più vicino). Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0556045259	Mediobanca 2010-2017 Fixed-Floating Rate	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,33%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004720436	Mediobanca 2011-2021 TV con Tasso Minimo e Tasso Massimo subordinato Lower Tier2	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360, con <i>floor</i> 4,5% e <i>cap</i> 7,5% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004839020	Mediobanca 2012-2017 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2,1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0783732455	Mediobanca 2012-2017 World Basket Linked	Premio al rimborso pari al 70% della <i>performance</i> degli indici componenti il paniere subordinato al verificarsi di un evento azionario. L'evento azionario si verifica se la <i>performance</i> del paniere (pari alla media asiatica delle 60 <i>performance</i> mensili dello stesso, a loro volta calcolate quale media aritmetica della <i>performance</i> di ciascun indice determinata sulla base del confronto tra il valore degli indici alle relative date di riferimento con il valore degli stessi alla data di osservazione iniziale) è maggiore o uguale a zero. Il paniere è composto dai seguenti indici: <ul style="list-style-type: none"> - Standard&Poor's 500; - EURO STOXX 50; - Nikkei 225. Le date di rilevazione hanno periodicità mensile, con prima data di osservazione il 20 luglio 2012 ed ultima il 9 giugno 2017.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS0811450757	Mediobanca 2012-2016 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0820711132	Mediobanca 2012-2017 Inflation Linked	Dalla terza cedola interessi annuali pari all'1,5% più la variazione annuale dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro, relativa al luglio precedente la data di godimento della cedola.
XS0821919171	Mediobanca 2012-2017 Indicizzato EURO STOXX 50	Premio al rimborso pari alla variazione dell'indice EURO STOXX 50 tra il 15 ottobre 2012 ed il 09 ottobre 2017 con un <i>floor</i> del 5,75%.
XS0835345082	Mediobanca 2012-2017 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2,1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004872427	Mediobanca 2013-2018 Indicizzato EURO STOXX 50	Premio eventuale al rimborso pari alla <i>performance</i> registrata dall'indice EURO STOXX 50 tra il 16 gennaio 2013 ed il 9 gennaio 2018. La cedola premio non potrà assumere valore negativo.
IT0004872435	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004884794	Mediobanca 2013-2018 Tasso Misto	Dalla seconda cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004884778	Mediobanca 2013-2018 Indicizzato EURO STOXX 50	Premio eventuale al rimborso pari alla <i>performance</i> registrata dall'indice EURO STOXX 50 tra il 25 febbraio 2013 ed il 19 febbraio 2018. La cedola premio non potrà assumere valore negativo.
IT0004890361	Mediobanca 2013-2018 Fix to Floater	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 1,3%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004892425	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 1,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0004899511	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004909682	Mediobanca 2013-2016 Tasso Misto	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al 5% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (13 giugno 2015 e 14 giugno 2016, 2017 e 2018) sia maggiore o uguale al valore dell'EURO STOXX 50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 18, 19, 20, 21 e 24 giugno 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0004921646	Mediobanca 2013-2020 Tasso Variabile Cap and Floor	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,4% con <i>floor</i> 3% e <i>cap</i> 4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005092330	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile Cap and Floor USD	Interessi trimestrali pari al tasso Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,7% con <i>floor</i> 1,5% e <i>cap</i> 4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola
IT0004924004	Mediobanca 2013-2021 Sintesi Tasso Misto	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al 6% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (14 novembre 2014, 14 maggio e 14 novembre 2015, 14 maggio e 12 novembre 2016, 13 maggio e 14 novembre 2017, 12 maggio e 14 novembre 2018, 14 maggio e 14 novembre 2019 14 maggio e 14 novembre 2020, 14 maggio e 13 novembre 2021) sia maggiore o uguale al valore dell'EURO STOXX 50 del 22 maggio 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0004924046	Mediobanca 2013-2021 Sintesi Tasso Misto USD	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al 6,5% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (14 novembre 2014, 14 maggio e 14 novembre 2015, 14 maggio e 12 novembre 2016, 13 maggio e 14 novembre 2017, 12 maggio e 14 novembre 2018, 14 maggio e 14 novembre 2019 14 maggio e 14 novembre 2020, 14 maggio e 13 novembre 2021) sia maggiore o uguale al valore dell'EURO STOXX 50 del 22 maggio 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0004931082	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile Cap&Floor	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,6% con <i>cap</i> 4,3% e <i>floor</i> 3% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004931090	Mediobanca 2013-2018 Opzione digitale EURO STOXX 50	Interessi annuali pari al 4% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (18 luglio 2014 e 2015, 16 luglio 2016, 18 luglio 2017 e 2018) sia pari, rispettivamente, al 100%, 102,5%, 102,5%, 105% e 105% del media aritmetica semplice dei valori di chiusura dell'EURO STOXX 50 del 18, 19, 20, 21 e 24 giugno 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0004935976	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile con Cap&Floor	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,8% con <i>cap</i> 4,5% e <i>floor</i> 3% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004936149	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50	Dalla terza cedola interessi annuali pari al 5,75% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (20 agosto 2016, 22 agosto 2017, 2018 e 2019, 21 agosto 2020 e 20 agosto 2021) sia maggiore al valore dell'EURO STOXX 50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 15, 16, 17, 18 e 19 agosto 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0004941875	Mediobanca 2013-2019 Inflazione Italiana	Dalla seconda cedola interessi annuali pari alla variazione annuale dell'indice nazionale dei prezzi al consumo per le famiglie di operai e impiegati (FOI), esclusi i tabacchi, (pubblicato dall'Istat) relativa al mese di ottobre precedente la data di pagamento, più uno <i>spread</i> del 2,2%.
IT0004952336	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile Cap&Floor	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,9% con <i>cap</i> 4,5% e <i>floor</i> 3% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004952401	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50	Dalla terza cedola interessi annuali pari al 4,25% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (17 settembre 2016, 16 settembre 2017, 18 settembre 2018, 2019, 2020 e 2021) sia maggiore al valore dell'EURO STOXX 50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 19, 20, 23, 24 e 25 settembre 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono pari all'1%.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0004958051	Mediobanca 2013-2023 Tasso Misto con Cap&Floor	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,7% con <i>cap</i> 4,5% e <i>floor</i> 3% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004958069	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50	Dalla terza cedola interessi annuali pari al 5,25% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (22 ottobre 2016, 21 ottobre 2017, 20 ottobre 2018, 22 ottobre 2019 e 2020 e 21 ottobre 2021) sia maggiore al valore dell'EURO STOXX 50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 17, 18, 19, 20 e 21 ottobre 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono pari all'1%.
IT0004967201	Mediobanca 2013-2023 Tasso Misto con Cap&Floor	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,7% con <i>cap</i> 4,5% e <i>floor</i> 3% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004965585	Mediobanca 2013-2019 Opzioni digitali EURO STOXX 50	Dalla terza cedola interessi annuali pari al 4,25% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EURO STOXX 50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (26 novembre 2016, 25 novembre 2017, 27 novembre 2018 e 2019) sia maggiore al valore dell'EURO STOXX 50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 26,27 e 29 novembre e 2 e 3 dicembre 2013. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono pari all'1%.
XS0993892909	Mediobanca 2014-2021 Fixed to Floating with Cap&Floor	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1% con <i>cap</i> 4,15% e <i>floor</i> 2,25% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004981889	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto con Cap e Floor	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,5% con <i>cap</i> 4,5% e <i>floor</i> 2,5% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004998172	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto	Dalla seconda cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,28%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0005004475	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto	Dalla seconda cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005013054	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al 4% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EuroSTOXX50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (17 maggio 2016, 18 maggio 2017, 17 maggio 2018, 16 maggio 2019, 19 maggio 2020 e 17 maggio 2021) sia maggiore al valore dell'EuroSTOXX50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 15,16,19, 20 e 21 maggio 2014. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0005021602	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al 4% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EuroSTOXX50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (17 giugno 2016, 19 giugno 2017, 19 giugno 2018, 18 giugno 2019, 17 giugno 2020 e 17 giugno 2021) sia maggiore al valore dell'EuroSTOXX50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 16, 17, 18, 19 e 20 giugno 2014. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0005021586	Mediobanca 2014-2021 Tasso Misto con Cap	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1% con <i>cap</i> 3,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005026999	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	Interessi annuali pari al 3,65% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EuroSTOXX50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (1 agosto 2015, 3 agosto 2016, 2 agosto 2017, 1 agosto 2018, 1 agosto 2019, 1 agosto 2020 e 3 agosto 2021) sia maggiore al valore dell'EuroSTOXX50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 30 e 31 luglio, 1, 4 e 5 agosto 2014. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0005044711	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	Interessi annuali pari al 3,65% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore dell'indice EuroSTOXX50, pari alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura di cinque giorni antecedenti le date di riferimento (6 ottobre 2015 e 2016, 5 ottobre 2017, 2018 e 2019, 6 ottobre 2020 e 2021) sia maggiore al valore dell'EuroSTOXX50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura del 30 settembre, 1, 2, 3 e 6 ottobre 2014. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0005127508	Mediobanca 2015-2025 Valore	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2,25% con un <i>floor</i> del 3%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005122830	Mediobanca 2015-2022 Opzioni digitali	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al 3,5% al verificarsi di un evento azionario. L'evento si verifica qualora il valore di ciascun indice del paniere alle date di riferimento finali (11 settembre 2017, 10 settembre 2018, 10 settembre 2019 10 settembre 2020, 10 settembre 2021 e 9 settembre 2022) sia maggiore al valore di ciascun indice del 10 settembre 2015. Il paniere è composto dai seguenti indici: – EURO STOXX 50; – Standard&Poor's 500; – Nikkei 225. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
IT0005143240	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile USD	Interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005143257	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile GBP	Interessi trimestrali pari al tasso GBP Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001278404	Mediocredito Centrale 1998-2018 Floored Top Side	Dalla sesta cedola interessi trimestrali (arrotondati allo 0,01% più vicino) pari al tasso Libor a 3 mesi maggiorato dello 0,5%. Se il tasso Libor sull'Euro a 3 mesi dovesse risultare superiore al 7% annuo la cedola trimestrale successiva sarà pari all'1,5% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola. Cedola trimestrale minima garantita pari allo 0,375%.
IT0001287249	Mediocredito Centrale 1998-2018 Step-Down	Decima cedola pari al 4% qualora il tasso Swap Euribor a 10 anni sia uguale o inferiore al 4%, altrimenti pari a zero. Parametro di indicizzazione rilevato il quinto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001271649	Mediocredito Lombardo 1998-2018 Reverse Floater Capped	Dall'undicesima cedola interessi annuali pari alla differenza (arrotondata allo 0,01% più vicino) tra il 15% ed il doppio del tasso Libor a 12 mesi (moltiplicato per 365/360). Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola. Le cedole non possono assumere valore negativo o essere superiori al 5,5%.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0001292850	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	Dalla sesta cedola interessi annuali pari al 70% del tasso Swap Euribor a 10 anni, arrotondati allo 0,01% più vicino. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001336368	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	Dalla sesta cedola interessi annuali (arrotondati allo 0,01% più vicino) pari al 70% del tasso Swap Euro a 10 anni, quotazione mid-market. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0001307286	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down Reverse Floater Capped	Dall'undicesima cedola interessi annuali pari alla differenza (arrotondata allo 0,01% più vicino) tra il 14% ed il doppio del tasso Libor sull'Euro a 12 mesi (moltiplicato per 365/360). Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola. Nessuna cedola potrà assumere valore negativo o superare il 5%.
IT0001302659	Sanpaolo IMI 1999-2019 Indicizzato Swap Euro 10 Anni Floor 3,25%	Interessi annuali (arrotondati allo 0,01% più vicino) pari al 75% del tasso Swap Euribor a 10 anni. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola. Cedola annuale garantita pari al 3,25%.
XS1086778641	Twin Set - Simona Barbieri 2014-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 5,875%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004497050	UBI Banca 2009-2019 Fixed-Floater	Dall'undicesima cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi, maggiorato dell'1,85%. Parametro di riferimento rilevato quattro giorni lavorativi antecedenti la data di godimento della cedola.
IT0004572860	UBI Banca 2010-2017 Sub Lower Tier II	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,4%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004767742	UBI Banca 2011-2018 Subordinato Lower Tier II - Tasso Misto Welcome Edition	Dalla tredicesima cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004841778	UBI Banca 2012-2019 Tasso Misto Welcome Edition	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 5%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0004851710	UBI Banca 2012-2016 Welcome Edition CGM	Dalla seconda cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 3%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1404902535	UBI Banca 2016-2026 Tasso Misto Callable	Dalla sesta cedola interessi annuali pari al tasso Euribor Swap a 5 anni più uno <i>spread</i> del 4,182% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1055725730	UniCredit 2014-2017 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,95%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1169707087	UniCredit 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1426039696	UniCredit 2016-2027 Tasso Misto Callable	Dalla sesta cedola interessi annuali pari al tasso Euribor Swap a 5 anni più uno <i>spread</i> del 4,316% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
DI SOCIETÀ ESTERE		
NL0009062215	ABN AMRO Bank 2009-2019 Royal Fisso - Variabile	Interessi annuali fissi che ogni 10 giorni antecedenti lo stacco della cedola, a partire dall'8-X-2011, possono essere trasformati in trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi maggiorato dello 0,75%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009289313	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal Euribor	Interessi trimestrali pari al massimo tra zero e la differenza tra l'8% e l'Euribor a 3 mesi. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009289339	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal 5,50% Inflazione	In aggiunta alla cedola fissa, pari al 5,5% per gli anni dal 2011 al 2013 e all'1,6% per gli anni dal 2014, verranno sommati interessi annuali pari al massimo tra zero e la variazione annuale dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro, relativa all'ottobre dell'anno precedente la data di godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS1214673565	ArcelorMittal 2015-2018 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2,03%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0625841142	Bank of America 2011-2018 TV Floored Capped Invest Bond	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360, con <i>floor</i> 4% e <i>cap</i> 8% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006706326	Barclays Bank 2009-2019 Inflation Floored Notes	Dalla terza cedola interessi annuali pari alla variazione annuale (purché non negativa) dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro relativa ai 16 mesi antecedenti la data di pagamento della cedola con <i>floor</i> pari al 3%.
IT0006708413	Barclays Bank 2009-2019 Floating Rate Notes USD	Interessi semestrali pari al massimo tra zero e il tasso USD Libor a 6 mesi, maggiorato dell'1,5% su base annua. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006709056	Barclays Bank 2009-2016 Obbligazioni con Cap	Interessi annuali pari al minimo tra 5% e l'Euribor a 6 mesi moltiplicato per 30/360 più uno <i>spread</i> dello 0,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006710880	Barclays Bank 2010-2025 Inflation Floored Notes	Dalla quarta cedola interessi pari al massimo tra 3% e la variazione annuale (purché non negativa) dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro, relativa al settembre dell'anno precedente la data di godimento della cedola, più uno <i>spread</i> dello 0,20%.
IT0006712142	Barclays Bank 2010-2025 7,5%	Interessi trimestrali pari alla differenza tra 7,5% e l'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>floor</i> pari allo 0%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006712951	Barclays Bank 2010-2017 Fixed Floating Rate Notes	Dalla quarta cedola interessi semestrali pari al massimo tra zero e l'Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> pari allo 0,6%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006715418	Barclays Bank 2010-2025 6% Inverse Floater Floored Notes	Dalla tredicesima cedola interessi semestrali pari al massimo tra 2% e la differenza tra 6% e l'Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0006715392	Barclays Bank 2010-2025 10,5% Inverse Floater Floored Notes	Dalla quinta cedola interessi semestrali pari al massimo tra 1% e la differenza tra 9% e il doppio del valore dell'Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006715483	Barclays Bank 2010-2017 Fixed Floater Notes	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari all'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,45%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1052683353	BMW Finance 2014-2017 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,35%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1218967377	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto USD	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1235187306	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto AUD	Dalla decima cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1235201735	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto NZD	Dalla decima cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 3%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1257901600	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2023 Tasso Misto	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,75%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1289967298	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2025 Tasso Misto USD	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,8%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1319787153	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2023 Inverse Floater USD	Dalla terza cedola interessi semestrali pari alla differenza tra 5,5% e il doppio del valore del tasso USD Libor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>floor</i> pari a zero. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS1385360505	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 Tasso Misto	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso GBP Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,80% con <i>cap</i> 5% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1408405725	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 Misto Misto USD	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,25% con <i>cap</i> 5,5% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1190302775	Citigroup 2015-2022 Fixed to Capped and Floored Floating Rate Notes	Dalla quinta cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>floor</i> 1,30% e <i>cap</i> 4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1241228649	Citigroup 2015-2023 Fixed to Capped Floating Rate Notes USD	Dalla tredicesima cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi più uno <i>spread</i> dello 0,2%, con <i>cap</i> 4,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1346520981	Citigroup Global Markets Holdings 2016-2021 USD Tasso Misto	Dalla quinta cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 1,10% e <i>floor</i> 0% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1093338082	Credit Suisse 2014-2019 Yield Securities	Interessi pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>floor</i> 1,55% e <i>cap</i> 10% fino al 31 luglio 2016 e <i>cap</i> 4,25% dal 31 ottobre 2016. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1289106038	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto USD	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 1%. Parametro di indicizzazione rilevato il giorno lavorativo della data del godimento della cedola.
XS1354962273	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto USD	Dalla sesta cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,5% con <i>cap</i> 4,3% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS1355035335	Credit Suisse 2016-2024 Tasso Misto	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al tasso Euribor a 1 mese moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,4% con <i>cap</i> 4,0% e <i>floor</i> 0% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il giorno lavorativo della data del godimento della cedola.
XS1396701168	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto GBP	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso GBP Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,4% con <i>cap</i> 4% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
DE000A1YC3F5	Daimler 2014-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,28%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1220057043	FCA Capital Ireland 2015-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,9%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1042118288	GE Capital 2014-2020 Floating Rate USD	Interessi trimestrali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,41%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0626808223	GE Capital European Funding 2011-2017 Floating Rate	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,84%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0254356057	GE Capital European Funding 2006-2021 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,225%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1130101931	Goldman Sachs Group 2014-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,75%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1240146891	Goldman Sachs Group 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,7%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS1241085353	Goldman Sachs International 2015-2027 Fixed to Floating	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,45%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1267261805	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating USD	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 6% e <i>floor</i> 1,25% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1317187646	Goldman Sachs International 2016-2028 Tasso Misto	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,50% con <i>cap</i> 3,5% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1317259148	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 4,25% e <i>floor</i> 1% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1317278361	Goldman Sachs International 2016-2026 Switchable Fixed to Floating USD	Dalla seconda cedola possibilità di trasformare le cedole in indicizzate con interessi annuali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,50% con <i>cap</i> 4,65% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006598830	KFW 2005-2025 Fixed Rate to CMS Capped	Dalla quarta cedola interessi annuali pari al quadruplo della differenza tra il tasso Euro Swap a 10 anni e il tasso Euro Swap a 2 anni. Nessuna cedola potrà avere valore inferiore allo 0% né superiore al tasso Euro Swap a 10 anni. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola. All'atto del rimborso verrà corrisposto un premio pari al massimo tra zero e la differenza tra il 40% del valore nominale delle obbligazioni e l'importo complessivo di tutte le cedole per tutti i periodi di interesse, inclusa la cedola variabile da corrispondersi alla data di rimborso.
IT0006719584	Macquarie Structured Securities 2011-2017 Step Up Energy	Premio al rimborso pari al 21% del valore nominale del prestito subordinato al verificarsi di un evento azionario. L'evento azionario si verifica se alla data di osservazione finale, il valore di riferimento dell'azione che ha realizzato la peggiore <i>performance</i> risulta essere almeno pari al proprio valore iniziale. Gli indici che compongono il paniere sono: – Enel (quotato sulla Borsa Italiana); – RWE A.G. (quotato sulla Deutsche Borse);

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0006719584	(segue)	– Total S.A. (quotato sull'Euronext Paris). Il valore iniziale del periodo è il prezzo di apertura rilevato il 18-IV-2011. Il valore finale del periodo è il prezzo di chiusura rilevato il 13-IV-2017.
XS1075471265	RCI Banque 2014-2017 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,72%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
FR0012674182	RCI Banque 2015-2018 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,58%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1212331265	SG Issuer 2015-2025 Indicizzato USD	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi, con <i>floor</i> 2% e <i>cap</i> 4,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1236574627	Société Générale 2016-2028 Tasso Misto	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,25% con <i>cap</i> 3,5% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1236580517	Société Générale 2016-2028 Tasso Misto USD	Dalla tredicesima cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,25% con <i>cap</i> 5% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1265876430	Société Générale 2015-2023 Tasso Misto USD	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 5% e <i>floor</i> 1,25% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1265944964	Société Générale 2016-2026 Tasso Misto USD	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell' 1% con <i>cap</i> 5,25% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009294032	The Royal Bank of Scotland 2010-2018 Obbligazione Royal Protezione	Dalla terza cedola interessi pari al massimo tra 2,75% e la variazione annuale (purché non negativa) dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro, relativa al dicembre precedente la data di godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
NL0009294040	The Royal Bank of Scotland 2010-2018 Obbligazione Royal Combinazione Perfetta	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al massimo tra zero e la differenza tra 10% ed il doppio dell'Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009403229	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Fixed to Floating Rate Note	Dalla quinta cedola interessi trimestrali pari all'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009408467	The Royal Bank of Scotland 2010-2022 Obbligazione Royal Operazione 10%	Dalla quinta cedola interessi semestrali pari al massimo tra zero e la differenza tra 10% ed il doppio dell'Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009483833	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 8% Steepener	Dalla quinta cedola interessi semestrali pari al massimo tra 3% ed il triplo della differenza tra l'Euribor Swap a 10 anni e l'Euribor Swap a 2 anni. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009487453	The Royal Bank of Scotland 2010-2025 Obbligazione Royal Top Inverse	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al massimo tra zero e la differenza tra 9% ed il doppio del valore dell'Euribor a 12 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009537943	The Royal Bank of Scotland 2010-2016 Obbligazione Royal 3% Variabile	Interessi trimestrali pari al massimo tra 3% e l'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1%. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009560002	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Obbligazione Royal Euribor con Leva	Dalla quinta cedola interessi trimestrali pari al massimo tra zero e l'1,5% dell'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
GB00B6HZ3R74	The Royal Bank of Scotland 2011-2017 Obiettivo 6%	Interessi trimestrali pari al 6% annuo qualora il tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 sia maggiore o uguale all'1% e minore o uguale al 4,5%, altrimenti la cedola sarà nulla. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
GB00B6HZ3D39	The Royal Bank of Scotland 2011-2017 Obbligazioni Inflazione Europea	Dalla terza cedola interessi annuali pari al massimo tra 1% e la variazione annuale (purché non negativa) dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro, relativa al marzo precedente la data di godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
GB00B6HZ2927	The Royal Bank of Scotland 2011-2016 Tasso Misto con Cap e Floor	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Euribor a 6 mesi con <i>floor</i> 3% e <i>cap</i> 5,5% annuali. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
GB00B6HYM000	The Royal Bank of Scotland 2011-2016 Obbligazione BRIC	Eventuale premio al rimborso pari alla variazione dell'indice S&P BRIC 40 tra il 22 dicembre 2016 ed il 29 dicembre 2011 con un <i>cap</i> del 60%.
XS1377769879	Unicredit Bank 2016-2026 4,20% Premiere Bond Fixed to Floater USD	Dalla sedicesima cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,25%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1377799355	Unicredit Bank 2016-2026 3,10% Premiere Bond Fixed to Floater GBP	Dalla sedicesima cedola interessi trimestrali pari al tasso GBP Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,25%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1372838083	Vodafone Group 2016-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari all'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,95%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1167637294	Volkswagen International Finance 2015-2018 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,3%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1216646825	Volkswagen Financial Services 2015-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,25%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1273542867	Volkswagen Leasing 2015-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,27%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
DI ENTI INTERNAZIONALI		
IT0006525932	BEI 1998-2018 Sticky Fixed Reverse Floater	Dalla sesta cedola interessi annuali pari alla differenza (arrotondata allo 0,01% più vicino) tra il 14,5% ed il doppio del tasso Libor sull'Euro a 12 mesi (moltiplicato per 365/360). Le cedole non potranno assumere valore negativo o essere superiori dello 0,5% rispetto a quella precedente. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0006527052	BEI 1999-2019 Eurostability Bond	Dalla nona cedola interessi pagabili annualmente oppure alla scadenza in base a rilevazioni trimestrali del rendimento lordo dei BTP con scadenza costante a 10 anni. Se dovesse rilevarsi, anche solo in un caso, un rendimento dei BTP superiore al 4,7%, gli interessi saranno pari al 30% pagabili alla scadenza, altrimenti interessi annuali del 4,5%. Parametro di riferimento pari alla media delle osservazioni effettuate i due giorni lavorativi antecedenti il 5 dei mesi di maggio, agosto, novembre e febbraio, a partire dal 5 maggio 1999 fino al 5 febbraio 2008.
IT0006527300	BEI 1999-2029 Step-Down	Dalla decima cedola, qualora la media aritmetica dei valori del tasso Swap sull'Euro a 10 anni <i>mid-price</i> sia inferiore o uguale al 4%, interesse annuo pari al 4%. In caso contrario cedola nulla. Parametro di riferimento pari alla media dei valori rilevati cinque giorni lavorativi antecedenti la data di pagamento delle cedole dal primo al nono anno.
XS0219808549	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked	A partire dalla terza cedola interessi annuali pari a cinque volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni, rilevati due giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola. Nessuna cedola potrà essere negativa o superiore al tasso Swap Euro a 10 anni; l'ultima cedola sarà pari all'eventuale differenza tra 30% e la somma delle cedole pagate precedentemente.
XS0220507023	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked	A partire dalla seconda cedola interessi annuali pari a cinque volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni, rilevati due giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola. Le cedole non potranno essere inferiori all'1,5%.
XS0222759689	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Floored	A partire dalla terza cedola interessi annuali pari a cinque volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni, rilevati due giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola. Le cedole non potranno essere inferiori all'1,25% o superiori al tasso Swap Euro a 10 anni.
XS0222844952	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Targeted Switch	A partire dalla terza cedola interessi annuali non negativi pari a tre volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 30 anni e quello a 5 anni, rilevati cinque giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola. Qualora ad una data di pagamento la somma delle cedole pagate precedentemente e di quella in pagamento sia uguale o superiore al 30%, sarà pagato un ammontare pari alla differenza tra il 30% e la somma delle cedole precedenti, e il parametro di indicizzazione diverrà il tasso swap Euro a 10 anni, rilevato tre giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016:

LISTED GOVERNMENT SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016:

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS0212674575	BEI 2005-2020 Fixed / Index-Linked	A partire dalla seconda cedola interessi annuali pari al 140% della variazione dell'indice armonizzato dei prezzi al consumo (escluso il tabacco) per l'area Euro relativo al mese di novembre. Parametri rilevati cinque giorni prima della data di pagamento delle cedole.
XS0233286078	BEI 2005-2025 Fixed / CMS-Linked con Premio al Rimborso	A partire dalla quarta cedola interessi annuali pari a quattro volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni. Le cedole non potranno essere negative o superiori al tasso Swap Euribor a 10 anni. Premio al rimborso pari alla differenza tra il 40% e la somma delle cedole pagate precedentemente.
XS0258132272	BEI 2006-2016 Price-Linked	A partire dalla seconda cedola interessi annuali pari al 148% della variazione dell'indice armonizzato dei prezzi al consumo (escluso il tabacco) per l'area Euro relativo al mese di aprile antecedente la data di godimento della cedola.
IT0006527524	BERS 1999-2024 Step-Down Mirror con Premio Euribor	Premio al rimborso pari alla somma delle 15 quotazioni del tasso Euribor a 12 mesi rilevate il secondo giorno antecedente il 5 marzo di ciascuno degli anni dal 2005 al 2019.
IT0006592981	BERS 2005-2025 CMS-Linked con Premio al Rimborso	A partire dalla quarta cedola interessi annuali pari a cinque volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni. Le cedole non potranno essere negative o superiori al tasso Swap Euribor a 10 anni. Premio al rimborso non negativo pari alla differenza tra il 40% e la somma delle cedole pagate precedentemente.
XS1410230806	BIRS 2016-2026 Tasso Misto USD	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 2,35% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006526302	Inter-American Development Bank 1998-2018 Reset	A partire dall'ottava cedola interessi nulli qualora il tasso Swap Euro a 10 anni, rilevato 5 giorni lavorativi antecedenti alla data di pagamento della settima cedola, sia superiore al 4%; in tal caso il prezzo di rimborso sarà pari al 150% del valore nominale. In caso contrario cedole pari al 7,5%.
IT0006525742	Inter-American Development Bank 1998-2018 Reverse Floater	Dalla sesta cedola interessi semestrali (arrotondati allo 0,01% più vicino) pari al 14,5%, diminuito del doppio del tasso Euro-Libor a 12 mesi moltiplicato per (365/360). Tali cedole non potranno essere negative o superiori al 5,5% annuo.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
IT0006596701	World Bank 2005-2025 CMS-Linked	A partire dalla quarta cedola interessi annuali pari a cinque volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni, rilevati cinque giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola. Le cedole non potranno essere negative o superiori al tasso Swap Euribor a 10 anni. Premio al rimborso non negativo pari alla differenza tra il 40% e la somma delle cedole pagate precedentemente.
XS1233613188	World Bank 2015-2023 linked to the Ethical Europe Equity Index	Dalla terza cedola interessi annuali pari alla <i>performance</i> dell'indice "Ethical Europe Equity Index" determinata come media aritmetica delle otto performance registrate dall'indice rispetto al proprio valore iniziale. Il valore di riferimento iniziale, determinato sulla base del valore di chiusura dell'indice rilevato in data 15/05/2015, è risultato pari a 204,203 punti. Il valore di riferimento finale è dato dalla media aritmetica semplice dei valori di chiusura dell'indice rilevato il 15 giugno 2016, 2017 e 2018, 17 giugno 2019, 15 giugno 2020, 2021, 2022 e 2023. Eventuale premio finale qualora l'evento non si verifichi pari al prodotto tra il valore nominale e il maggiore tra il rendimento medio dell'indice (pari alla media aritmetica dei livelli di chiusura dell'indice in ciascuna data di osservazione meno il livello iniziale dell'indice e diviso per il livello iniziale dello stesso) e zero.

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			DI STATO					
IT0000366655	BTP 1993-2023 9%	157,49	10,03	10,34	4,46	7,04	5,79	0,88
IT0001086567	BTP 1996-2026 7,25%	155,95	11,72	13,02	5,75	10,04	4,70	1,42
IT0001444378	BTP 2000-2031 6%	155,69	14,41	16,67	8,57	14,10	3,89	1,73
IT0003256820	BTP 2002-2033 5,75%	155,51	15,02	17,52	9,38	16,07	3,73	1,86
IT0001174611	BTP 1997-2027 6,5%	151,71	12,57	14,10	6,78	11,04	4,33	1,52
IT0004532559	BTP 2009-2040 5%	151,36	16,55	20,63	12,33	24,02	3,33	2,25
IT0004286966	BTP 2007-2039 5%	151,32	16,45	20,40	12,00	23,01	3,33	2,17
IT0004923998	BTP 2013-2044 4,75%	150,37	—	22,04	13,19	28,02	3,18	2,32
IT0003535157	BTP 2003-2034 5%	146,41	15,51	18,59	10,62	18,01	3,44	1,95
IT0001278511	BTP 1998-2029 5,25%	142,85	13,83	15,92	8,27	13,04	3,70	1,66
IT0004889033	BTP 2013-2028 4,75%	134,96	12,91	14,91	7,61	12,02	3,55	1,59
IT0003934657	BTP 2005-2037 4%	132,31	16,29	19,27	12,23	20,07	3,04	2,07
IT0004513641	BTP 2009-2025 5%	131,56	11,17	12,38	5,30	8,08	3,83	1,17
IT0004848831	BTP 2012-2022 5,5%	129,87	9,70	10,24	4,64	6,04	4,27	0,68
IT0004801541	BTP 2012-2022 5,5%	129,40	9,59	10,08	4,51	5,08	4,29	0,27
IT0004644735	BTP 2010-2026 4,5%	128,76	11,65	12,86	5,79	10,02	3,52	1,45
IT0004356843	BTP 2008-2023 4,75%	127,31	10,32	11,11	5,08	7,01	3,76	0,78
IT0004953417	BTP 2013-2024 4,5%	125,87	—	11,76	4,74	8,01	3,60	1,14
IT0004759673	BTP 2011-2022 5%	124,92	9,10	9,48	4,03	5,08	4,04	0,53
IT0004898034	BTP 2013-2023 4,5%	124,76	—	11,01	4,76	6,10	3,63	0,77
IT0005024234	BTP 2014-2030 3,5%	122,68	—	—	8,93	13,08	2,87	1,65
IT0004695075	BTP 2011-2021 4,75%	122,19	8,59	8,84	3,84	4,08	3,92	0,00
IT0005001547	BTP 2014-2024 3,75%	120,65	—	—	4,99	8,02	3,13	1,10

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			DI STATO					
IT0004009673	BTP 2006-2021 3,75%	116,95	8,49	8,72	3,95	5,01	3,23	0,38
IT0004966401	BTP 2013-2021 3,75%	116,23	—	8,52	3,62	4,10	3,25	0,36
IT0004634132	BTP 2010-2021 3,75%	115,91	8,01	8,26	3,47	4,08	3,26	0,31
IT0004594930	BTP 2010-2020 4%	115,81	7,52	7,38	3,16	4,02	3,48	0,19
IT0003644769	BTP 2004-2020 4,5%	115,68	6,98	6,69	2,64	3,07	3,92	0,12
IT0004536949	BTP 2009-2020 4,25%	115,17	7,11	6,84	2,70	3,08	3,72	0,11
IT0004489610	BTP 2009-2019 4,25%	113,17	6,41	5,90	2,25	3,02	3,79	0,09
IT0004423957	BTP 2008-2019 4,5%	111,99	5,88	5,17	1,90	2,08	4,05	0,01
IT0003493258	BTP 2003-2019 4,25%	111,01	5,79	5,10	1,93	2,07	3,86	-0,01
IT0005045270	BTP 2014-2024 2,5%	110,99	—	—	5,23	8,05	2,26	1,13
IT0004361041	BTP 2008-2018 4,5%	109,42	5,05	4,24	1,54	2,01	4,15	-0,02
IT0005028003	BTP 2014-2021 2,15%	109,00	—	—	4,26	5,05	1,98	0,48
IT0004957574	BTP 2013-2018 3,5%	108,52	—	4,92	1,81	2,05	3,25	-0,02
IT0004273493	BTP 2007-2018 4,5%	107,22	4,50	3,62	1,29	1,07	4,24	-0,05
IT0004992308	BTP 2014-2019 2,5%	106,97	—	4,92	2,06	2,10	2,35	0,04
IT0004907843	BTP 2013-2018 3,5%	106,75	—	4,08	1,50	1,11	3,30	-0,02
IT0003242747	BTP 2002-2017 5,25%	105,82	3,80	2,95	0,95	1,01	5,02	-0,10
IT0004867070	BTP 2012-2017 3,5%	104,81	4,21	3,29	1,09	1,04	3,36	-0,10
IT0005030504	BTP 2014-2019 1,5%	104,46	—	—	2,39	3,01	1,44	0,05
IT0005069395	BTP 2014-2019 1,05%	103,25	—	—	2,68	3,05	1,01	0,10
IT0005058463	BTP 2014-2018 0,75%	101,25	—	—	1,21	1,06	0,74	-0,06
IT0004922909	CCTeu 2013-2018	103,76	—	2,88	1,48	2,04	1,63	0,08
IT0005009839	CCTeu 2013-2019	103,10	—	—	1,68	3,04	1,05	0,16
IT0005056541	CCTeu 2014-2020	101,95	—	—	1,99	4,05	0,64	0,21
IT0004716319	CCTeu 2011-2018	101,58	3,86	2,55	1,21	1,09	0,86	-0,01

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
IT0004652175	CCTeu 2010-2017	100,92	3,51	2,12	0,88	1,03	0,66	-0,04
XS0098449456	Republic of Italy 1999-2029 CMS 30Y con Floor 4,25%	124,37	11,70	12,10	9,15	13,00	3,41	2,09
XS0100688190	Republic of Italy 1999-2019 Euro CMS	99,99	4,92	2,38	1,14	3,02	0,64	0,65
DE0001141679	BOBL 2013-2018 1%	103,81	—	2,26	0,77	2,03	0,96	-0,65
DE0001141703	BOBL 2014-2019 0,25%	102,99	—	—	1,60	3,03	0,24	-0,65
DE0001141661	BOBL 2013-2018 0,25%	101,63	—	1,83	0,56	1,09	0,24	-0,65
ES00000124V5	Bonos 2014-2019 2,75%	107,91	—	—	1,81	2,09	2,54	-0,04
ES00000123Q7	Bonos 2012-2018 4,5%	107,38	—	3,82	1,42	1,07	4,19	-0,15
ES00000126C0	Bonos 2014-2020 1,4%	104,98	—	—	3,03	3,07	1,33	0,01
ES00000126V0	Bonos 2014-2017 0,5%	100,92	—	—	1,02	1,04	0,49	-0,19
DE0001135366	Bund 2008-2040 4,75%	204,09	11,83	19,87	13,89	24,00	2,32	0,27
DE0001135325	Bund 2007-2039 4,25%	189,28	11,26	19,77	14,70	23,00	2,24	0,25
DE0001135226	Bund 2003-2034 4,75%	182,59	10,46	16,47	10,97	18,00	2,60	0,11
DE0001135176	Bund 2000-2031 5,5%	179,60	8,78	14,41	8,69	14,06	3,06	0,01
DE0001135275	Bund 2005-2037 4%	176,37	11,44	19,25	12,65	20,06	2,26	0,20
DE0001135432	Bund 2010-2042 3,25%	173,36	13,26	22,93	15,40	26,00	1,87	0,31
DE0001102341	Bund 2014-2046 2,5%	160,63	—	—	17,71	30,01	1,55	0,37
DE0001135085	Bund 1998-2028 4,75%	158,98	7,79	12,54	7,23	12,00	2,98	-0,12
DE0001135481	Bund 2012-2044 2,5%	157,17	14,61	24,73	15,95	28,00	1,59	0,35
DE0001134922	Bund 1994-2024 6,25%	150,79	4,76	7,59	3,82	7,06	4,14	-0,40
DE0001135440	Bund 2011-2021 3,25%	119,41	3,49	5,22	2,27	5,00	2,72	-0,56
DE0001102325	Bund 2013-2023 2%	117,60	—	8,32	4,10	7,01	1,70	-0,43
DE0001102358	Bund 2014-2024 1,5%	114,85	—	—	4,92	7,10	1,30	-0,36
DE0001135457	Bund 2011-2021 2,25%	114,79	3,74	5,21	2,68	5,02	1,96	-0,56

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
DE0001135408	Bund 2010-2020 3%	114,69	3,08	4,12	1,72	4,00	2,61	-0,61
DE0001135424	Bund 2010-2021 2,5%	114,22	3,16	4,65	2,22	4,06	2,18	-0,60
DE0001135465	Bund 2011-2022 2%	114,17	3,93	6,10	2,92	5,06	1,75	-0,53
DE0001135390	Bund 2009-2020 3,25%	113,86	2,31	3,62	1,40	3,06	2,85	-0,64
DE0001135473	Bund 2012-2022 1,75%	113,77	4,50	6,82	2,99	6,00	1,53	-0,50
DE0001102317	Bund 2013-2023 1,5%	113,57	—	8,16	3,94	6,10	1,32	-0,44
DE0001102309	Bund 2013-2023 1,5%	113,13	2,33	7,79	3,86	6,07	1,32	-0,45
DE0001135499	Bund 2012-2022 1,5%	112,48	4,70	7,11	3,22	6,02	1,33	-0,49
DE0001135416	Bund 2010-2020 2,25%	112,26	2,92	4,31	2,04	4,02	2,00	-0,64
DE0001135374	Bund 2008-2019 3,75%	111,16	1,35	1,90	0,83	2,06	3,37	-0,64
DE0001102366	Bund 2014-2024 1%	110,85	—	—	4,83	8,01	0,90	-0,32
DE0001135358	Bund 2008-2018 4,25%	109,90	1,05	1,82	0,58	2,00	3,86	-0,63
DE0001135341	Bund 2007-2018 4%	107,10	0,83	1,36	0,48	1,06	3,73	-0,66
DE0001135333	Bund 2007-2017 4,25%	104,91	0,44	0,91	0,21	1,00	4,05	-0,58
GR0110029312	GGB 2014-2017 3,375%	96,79	—	—	17,06	1,00	3,48	6,64
GR0114028534	GGB 2014-2019 4,75%	90,60	—	—	13,86	2,09	5,24	8,66
GR0128010676	GGB 2012-2023 Step Up 2%	75,06	15,62	7,20	11,70	6,07	3,99	8,25
GR0128011682	GGB 2012-2024 Step Up 2%	72,95	16,71	7,22	10,56	7,07	4,11	8,24
GR0128012698	GGB 2012-2025 Step Up 2%	71,01	16,84	7,71	12,63	8,07	4,22	8,23
GR0128013704	GGB 2012-2026 Step Up 2%	70,70	17,33	9,19	16,41	9,07	4,24	7,94
GR0128014710	GGB 2012-2027 Step Up 2%	68,78	16,64	9,07	15,60	10,07	4,36	8,00
GR0133006198	GGB 2012-2028 Step Up 2%	67,13	17,59	9,10	15,62	11,07	4,46	8,02
GR0133007204	GGB 2012-2029 Step Up 2%	65,81	18,22	8,91	14,24	12,07	4,55	8,00
GR0133008210	GGB 2012-2030 Step Up 2%	65,01	18,28	9,08	15,93	13,07	4,61	7,93
GR0133009226	GGB 2012-2031 Step Up 2%	64,70	18,80	10,00	17,06	14,07	4,63	7,79

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
GR0133010232	GGB 2012-2032 Step Up 2%	63,70	19,32	9,80	14,90	15,07	4,70	7,78
GR0138005716	GGB 2012-2033 Step Up 2%	63,57	19,36	10,53	15,40	16,07	4,71	7,66
GR0138006722	GGB 2012-2034 Step Up 2%	62,58	18,81	10,38	15,38	17,07	4,79	7,67
GR0138007738	GGB 2012-2035 Step Up 2%	61,06	18,37	9,54	13,81	18,07	4,91	7,76
GR0138014809	GGB 2012-2042 Step Up 2%	60,69	18,11	10,15	12,96	25,08	4,94	7,24
GR0138008744	GGB 2012-2036 Step Up 2%	60,56	18,44	9,57	14,17	19,07	4,95	7,72
GR0138009759	GGB 2012-2037 Step Up 2%	60,52	18,54	9,87	13,93	20,08	4,95	7,62
GR0138012787	GGB 2012-2040 Step Up 2%	60,27	18,43	10,05	13,32	23,08	4,97	7,41
GR0138010765	GGB 2012-2038 Step Up 2%	60,02	18,25	9,39	14,04	21,08	4,99	7,60
GR0138013793	GGB 2012-2041 Step Up 2%	60,01	17,92	9,66	11,64	24,08	4,99	7,38
GR0138011771	GGB 2012-2039 Step Up 2%	60,00	18,29	9,76	12,97	22,08	5,00	7,52
FR0010371401	OAT 2005-2038 4%	166,60	13,22	19,99	13,94	22,04	2,40	0,75
FR0011461037	OAT 2012-2045 3,25%	158,68	—	25,05	17,06	28,11	2,04	0,93
FR0000571150	OAT 1993-2025 6%	155,07	6,92	10,39	5,21	9,03	3,86	0,07
FR0011883966	OAT 2013-2030 2,5%	127,83	—	—	9,57	13,10	1,95	0,43
FR0011317783	OAT 2011-2027 2,75%	127,40	9,21	13,67	7,01	11,03	2,15	0,29
FR0011196856	OAT 2011-2022 3%	119,29	5,25	6,80	3,81	5,09	2,51	-0,28
FR0011059088	OAT 2010-2021 3,25%	119,24	4,75	6,18	3,42	5,03	2,72	-0,33
FR0011337880	OAT 2011-2022 2,25%	115,82	5,92	8,11	4,09	6,03	1,94	-0,23
FR0010854182	OAT 2009-2020 3,5%	115,24	3,14	4,35	1,87	3,09	3,03	-0,45
FR0011962398	OAT 2013-2024 1,75%	114,63	—	—	5,30	8,04	1,52	0,01
FR0000189151	OAT 2003-2019 4,25%	113,53	2,13	2,56	1,17	2,09	3,74	-0,50
FR0011486067	OAT 2012-2023 1,75%	113,44	—	9,05	4,09	6,10	1,54	-0,18
FR0010949651	OAT 2009-2020 2,5%	112,72	3,76	5,15	2,19	4,03	2,21	-0,41
FR0011993179	OAT 2013-2019 0,5%	103,30	—	—	1,55	3,04	0,48	-0,46

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
ES0000012411	Obligaciones del Estado 2002-2032 5,75%	157,54	17,71	18,08	9,21	16,01	3,64	1,65
ES00000120N0	Obligaciones del Estado 2007-2040 4,9%	152,28	—	—	9,90	24,01	3,21	2,11
ES0000011868	Obligaciones del Estado 1999-2029 6%	151,92	15,72	16,10	7,78	12,07	3,94	1,45
ES00000124C5	Obligaciones del Estado 2013-2028 5,15%	141,26	—	16,27	7,06	12,04	3,64	1,47
ES0000012932	Obligaciones del Estado 2005-2037 4,2%	137,16	—	—	7,89	20,07	3,06	1,98
ES00000122E5	Obligaciones del Estado 2010-2025 4,65%	130,65	14,39	13,62	4,84	9,01	3,55	1,09
ES00000123X3	Obligaciones del Estado 2013-2023 4,4%	126,09	—	12,19	4,01	7,04	3,48	0,73
ES00000123B9	Obligaciones del Estado 2011-2021 5,5%	125,62	10,33	9,34	3,10	4,10	4,37	0,17
ES00000124W3	Obligaciones del Estado 2014-2024 3,8%	121,78	—	—	3,99	7,10	3,12	0,91
ES00000122D7	Obligaciones del Estado 2010-2020 4%	115,11	9,85	7,29	3,02	3,10	3,47	0,05
ES0000012783	Obligaciones del Estado 2002-2017 5,5%	106,10	—	—	0,80	1,00	5,18	-0,12
PTOTEQOE0015	Obrigacoes do Tesouro 2013-2024 5,65%	118,97	—	—	0,88	7,07	4,74	2,84
PTOTEAOE0021	Obrigacoes do Tesouro 2008-2023 4,95%	115,52	—	—	1,26	7,03	4,28	2,59
PTOTECOE0029	Obrigacoes do Tesouro 2010-2020 4,8%	112,08	—	—	1,36	3,11	4,28	1,62
PTOTEMOE0027	Obrigacoes do Tesouro 2009-2019 4,75%	110,21	—	—	1,62	2,11	4,30	1,21
PTOTENOE0018	Obrigacoes do Tesouro 2008-2018 4,45%	107,47	—	—	1,62	1,11	4,14	0,60

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			PTOTELOE0010	Obrigacoes do Tesouro 2007-2017 4,35%	105,22		—	—
PTOTEROE0014	Obrigacoes do Tesouro 2014-2030 3,875%	104,31	—	—	2,07	13,07	3,71	3,46
PTOTE5OE0007	Obrigacoes do Tesouro 2006-2037 4,1%	103,84	—	—	-2,09	20,09	3,94	3,83
NL0010071189	Regno dei Paesi Bassi 2012-2033 2,5%	136,32	—	—	9,35	16,06	1,83	0,25
BE0000291972	Regno del Belgio 1997-2028 5,5%	160,18	—	12,68	7,29	11,08	3,43	0,28
BE0000321308	Regno del Belgio 2011-2021 4,25%	124,64	—	—	2,91	5,02	3,40	-0,39
IT0006527532	Repubblica Ellenica 1999-2019 5%	95,68	10,44	6,49	6,83	2,08	5,22	6,79
FI4000047089	Repubblica Finlandese 2012-2022 1,625%	112,04	—	—	3,73	6,02	1,44	-0,29
AT0000A10683	Republic of Austria 2013-2034 2,4%	131,25	—	17,38	8,43	17,10	1,82	0,56
AT0000386115	Republic of Austria 2004-2020 3,9%	117,80	3,15	4,38	1,66	4,00	3,31	-0,45
AT0000A105W3	Republic of Austria 2013-2023 1,75%	114,70	—	9,20	4,36	7,03	1,52	-0,24
AT0000385745	Republic of Austria 2003-2018 4,65%	108,02	1,16	1,48	0,42	1,06	4,30	-0,52
XS0224713254	Republic of Austria 2005-2025 CMS-Linked	105,90	3,99	4,39	3,49	9,00	0,97	0,37
IE00BJ38CR43	Republic of Ireland 2014-2030 2,4%	120,58	—	—	9,24	13,10	1,99	0,82
IE00B28HXX02	Republic of Ireland 2007-2018 4,5%	110,99	—	—	1,14	2,03	4,05	-0,26
DI ENTI E SOCIETÀ								
XS0951567030	A2A 2013-2021 4,375%	117,24	—	7,82	4,35	4,06	3,73	0,51
XS1004874621	A2A 2013-2022 3,625%	116,69	—	9,82	6,01	5,06	3,10	0,55

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			XS0452314536	Assicurazioni Generali 2009-2024 5,125%	126,03		9,57	10,31
XS0542534192	Atlantia 2010-2025 4,375%	127,88	10,24	10,86	2,76	9,02	3,42	1,17
IT0004869985	Atlantia 2012-2018 3,625%	108,72	5,26	4,66	2,03	2,05	3,33	0,02
IT0001330411	Banca Carige 1999-2019 Indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni con Floor 4%	102,28	4,32	4,45	3,47	2,10	3,91	3,16
XS0570270370	Banca Carige 2010-2020 7,321%	96,43	—	3,38	0,56	4,05	7,59	8,28
IT0000966017	Banca Commerciale Italiana 1997-2027 Zero Coupon	76,31	14,18	12,90	5,31	10,06	0,00	2,60
IT0001200390	Banca Commerciale Italiana 1998-2028 Zero Coupon	74,38	15,27	13,36	5,08	11,07	0,00	2,57
IT0004936545	Banca IMI 2013-2019 4,5% Sprint BancoPosta	107,46	—	4,91	2,98	3,02	2,97	1,19
IT0004957020	Banca IMI 2013-2019 Tasso Fisso Sprint BancoPosta	107,28	—	4,70	2,82	3,04	2,93	1,32
IT0004796451	Banca IMI 2012-2018 Collezione Step Up	106,72	4,66	3,93	0,90	1,08	4,26	0,69
IT0004611932	Banca IMI 2010-2017 Tasso Variabile con Tasso Minimo	99,72	3,87	2,43	1,10	1,00	0,10	0,38
IT0004771710	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 StepByStep BancoPosta	103,01	4,95	4,78	1,72	1,05	5,72	3,79
XS1051696398	Banca Monte dei Paschi di Siena 2014-2019 3,625%	99,75	—	—	2,41	2,09	3,63	3,72
XS0540544912	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5,6%	92,08	4,07	5,85	-0,57	4,02	6,08	7,87
XS0503326083	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5%	90,31	4,10	5,43	-1,19	3,09	5,53	8,04
XS0236480322	Banca Monte dei Paschi di Siena 2005-2017 Tasso Variabile	87,90	—	4,64	-1,07	1,05	1,24	10,77
XS0597182665	Banca Popolare di Milano 2011-2021 7,125%	107,58	7,72	7,36	2,32	4,08	6,62	5,24

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
XS0985326502	Banca Popolare di Vicenza 2013-2018 5%	95,99	—	1,95	-2,28	2,03	5,20	6,91
XS0632503412	Banco Popolare 2011-2021 6,375%	104,25	7,01	6,15	0,81	4,11	6,11	5,36
XS0555834984	Banco Popolare 2010-2020 6%	103,11	6,66	5,76	2,40	4,04	5,81	5,17
XS1044894944	Banco Popolare 2014-2019 3,5%	102,79	—	—	2,38	2,08	3,40	2,42
XS1070681397	Banco Popolare 2014-2018 2,375%	100,85	—	—	2,44	1,06	2,35	1,81
IT0001304341	BIM-IMI 1999-2024 Fixed & Zero con Premio Fisso al Rimborso	183,90	12,75	10,67	5,83	7,07	0,00	2,39
IT0001271003	BIM-IMI 1998-2018 Step-Down con Premio Fisso al Rimborso	150,93	6,95	5,13	3,30	2,04	0,00	1,14
IT0005025389	CDP 2014-2021 2,75%	109,90	—	—	3,85	4,11	2,50	0,69
IT0005068850	CDP 2014-2018 1%	101,75	—	—	1,06	1,06	0,98	-0,11
IT0001312708	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Eurostability Bond	118,65	6,76	5,64	2,79	2,08	0,00	1,94
IT0001197083	Centrobanca 1998-2018 Zero Coupon	98,30	5,27	4,38	2,91	1,07	0,00	1,09
IT0001300992	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro a 10 Anni	98,02	4,69	3,19	1,20	2,06	0,62	1,40
XS1088811432	CMC di Ravenna 2014-2021 7,5%	87,20	—	—	5,83	5,01	8,78	11,12
IT0004870926	Credem 2012-2018 4,7% Amortizing Callable	102,32	—	—	3,30	1,05	4,59	3,06
IT0004737489	Credem 2011-2017 4,5% Amortizing	102,00	—	—	3,97	1,00	4,48	2,49
IT0001317707	Crediop 1999-2019 Step-Down Lifestyle Accrued Interest	155,66	11,95	6,82	3,27	2,08	0,00	3,59
IT0001308607	Crediop 1999-2024 Step-Down	146,80	12,22	11,74	5,92	7,07	0,00	4,12

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
IT0004729452	Dexia Crediop 2011-2017 5%	104,15	5,82	5,11	2,46	1,05	4,80	2,03
IT0004650781	Dexia Crediop 2010-2020 Zero Coupon	93,66	7,81	6,52	5,38	4,03	0,00	1,53
IT0005030306	E.S.T.R.A. 2014-2019 5%	101,55	—	—	6,20	3,00	4,92	4,44
XS0170343247	Enel 2003-2018 4,75%	109,04	4,43	3,72	1,70	1,11	4,35	0,11
IT0004794142	Enel 2012-2018 4,875%	107,75	4,74	3,70	1,70	1,07	4,52	0,14
IT0004794159	Enel 2012-2018 Tasso Variabile	104,73	3,69	2,52	1,07	1,07	2,89	0,12
XS1023703090	Eni 2014-2029 3,625%	123,44	—	5,00	5,90	12,07	2,93	1,56
XS0970852348	Eni 2013-2025 3,75%	122,02	—	10,16	4,20	9,02	3,07	1,21
XS0951565091	Eni 2013-2023 3,25%	116,75	—	8,44	3,49	7,00	2,78	0,79
XS0521000975	Eni 2010-2020 4%	114,24	4,31	5,16	2,48	4,00	3,50	0,40
XS0741137029	Eni 2012-2020 4,25%	114,22	3,73	4,80	2,24	3,07	3,72	0,27
XS0563739696	Eni 2010-2018 3,5%	106,68	2,65	2,85	1,72	1,06	3,28	-0,69
IT0004760655	Eni 2011-2017 4,875%	106,13	2,85	2,21	1,11	1,03	4,59	0,09
IT0004760648	Eni 2011-2017 Tasso Variabile	103,27	2,61	1,02	0,59	1,03	2,64	0,15
XS1119021357	Exor 2014-2024 2,5%	105,28	—	—	3,49	8,03	2,37	1,81
XS0954289913	Gamenet 2013-2018 7,25%	102,25	—	9,66	8,54	2,01	7,46	6,43
XS0923605470	Indesit Company 2013-2018 4,5%	106,98	—	6,29	3,14	1,09	4,20	0,63
IT0001304010	Interbanca 1999-2021 Coupon Reset	127,80	7,51	5,57	3,09	4,07	0,00	3,52
XS0971213201	Intesa Sanpaolo 2013-2023 6,625%	117,80	—	8,80	2,21	7,02	5,62	3,75
XS0986194883	Intesa Sanpaolo 2013-2023 4%	117,00	—	9,35	1,82	7,04	3,41	1,53
XS1018032950	Intesa Sanpaolo 2014-2022 3,5%	113,14	—	1,85	2,89	5,06	3,09	1,05
XS0842828120	Intesa Sanpaolo 2012-2019 4,375%	112,80	6,67	6,03	2,24	3,03	3,87	0,45
XS0500187843	Intesa Sanpaolo 2010-2020 4,125%	112,12	6,65	6,35	2,21	3,09	3,67	0,86

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			XS0526326334	Intesa Sanpaolo 2010-2020 5,15%	109,00		6,59	6,15
XS0555977312	Intesa Sanpaolo 2010-2018 4%	108,00	5,05	4,36	1,58	2,04	3,70	0,57
XS0452166324	Intesa Sanpaolo 2010-2019 5%	106,61	5,89	5,08	2,76	3,02	4,68	2,83
XS1077772538	Intesa Sanpaolo 2014-2021 2%	104,55	—	—	2,70	4,11	1,91	1,05
XS1057822766	Intesa Sanpaolo 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	100,75	—	—	0,88	2,09	1,07	0,81
IT0001086658	Istituto Bancario San Paolo di Torino 1997-2022 Zero Coupon	91,99	8,20	6,75	5,20	5,07	0,00	1,50
XS0458887030	Leonardo-Finmeccanica 2009-2022 5,25%	115,25	8,25	9,80	6,36	5,06	4,55	2,29
XS0215093534	Leonardo-Finmeccanica 2005-2025 4,875%	115,00	—	8,86	6,59	8,08	4,23	2,90
XS0182242247	Leonardo-Finmeccanica 2003-2018 5,75%	112,10	5,74	5,88	3,11	2,05	5,12	0,75
XS0999654873	Leonardo-Finmeccanica 2013-2021 4,5%	110,02	—	8,42	5,35	4,06	4,08	2,16
XS0861828407	Leonardo-Finmeccanica 2012-2017 4,375%	106,25	4,92	5,26	2,89	1,05	4,11	0,01
XS1083010311	L'Isolante K-Flex 2014-2020 6%	100,75	—	—	6,44	4,00	5,95	5,78
XS0808635352	Manutencoop Facility Management 2013-2020 8,5%	83,41	—	-0,31	8,22	4,01	10,55	14,52
XS0991759076	Marcolin 2013-2019 8,5%	101,00	—	6,31	8,52	3,04	8,59	8,31
IT0004917842	Mediobanca 2013-2023 5,75%	113,74	—	7,78	4,52	6,09	5,05	3,44
IT0004608797	Mediobanca 2010-2020 Primo Atto 4,5%	112,59	6,94	6,67	3,12	3,10	3,99	1,15
IT0004645542	Mediobanca 2010-2020 Secondo Atto 5% Subordinato Lower Tier 2	111,42	7,38	7,03	5,21	4,04	4,48	2,23
IT0004921646	Mediobanca 2013-2020 Tasso Variabile Cap and Floor	107,01	—	5,40	3,45	3,11	2,86	1,23

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			IT0004935976	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile con Cap&Floor	106,75		—	5,48
IT0004720436	Mediobanca 2011-2021 T.V. con Tasso Minimo e Tasso Massimo Sub. Lower Tier2	106,50	6,44	5,39	3,84	4,11	4,38	3,21
IT0004931082	Mediobanca 2013-2020 Tasso Variabile Cap&Floor	106,07	—	5,61	3,88	7,00	2,89	2,12
XS0993892735	Mediobanca 2014-2022 3,2%	105,72	—	4,93	2,85	5,06	3,02	2,10
IT0004981871	Mediobanca 2014-2022 3,2%	105,67	—	—	3,02	5,07	3,02	2,12
XS1046272420	Mediobanca 2014-2019 2,25%	104,80	—	—	2,17	2,08	2,14	0,47
IT0004952336	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile Cap&Floor	104,60	—	4,94	2,70	7,02	2,93	2,36
IT0004965577	Mediobanca 2013-2018 3,2%	104,51	—	4,52	2,11	2,05	3,06	1,30
XS1137512312	Mediobanca 2014-2017 0,875%	100,89	—	—	1,68	1,04	0,86	0,23
IT0004783046	Mediobanca 2011-2017 Atto Unico Zero Coupon	99,07	4,53	3,84	1,84	1,05	0,00	0,64
IT0001287249	Mediocredito Centrale 1998-2018 Step-Down	142,43	7,62	5,30	3,77	2,05	0,00	4,40
IT0001306171	Mediocredito Centrale 1999-2019 Step-Down Zero Coupon	141,92	7,55	5,55	3,50	2,07	0,00	2,12
IT0001203253	Mediocredito Centrale 1998-2028 Zero Coupon	73,60	15,93	12,93	5,35	11,07	0,00	2,67
IT0001292850	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	98,60	5,61	3,65	1,44	2,06	0,61	1,17
IT0001336368	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	97,58	5,16	3,18	1,00	2,11	0,37	1,21
IT0001205589	Mediocredito Lombardo 1998-2028 Zero Coupon	73,90	15,98	12,75	5,73	11,07	0,00	2,63
IT0004936289	Mittel 2013-2019 6% Callable	105,02	—	5,41	4,41	3,00	5,79	4,26
XS1074596344	Officine Maccaferri 2014-2021 5,75%	85,50	—	—	1,06	4,11	6,83	9,73

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
XS0956262892	Salini Impregilo 2013-2018 6,125%	110,00	—	—	7,64	2,01	5,56	1,24
IT0001302659	Sanpaolo IMI 1999-2019 Indicizzato Swap Euro 10 Anni Floor 3,25%	105,38	5,02	4,33	3,22	2,06	3,08	1,11
XS0931919947	Sisal Holding 2013-2017 7,25%	100,90	—	6,70	8,72	1,03	7,31	6,57
XS0806449814	Snam 2012-2019 5%	113,00	4,57	4,05	1,85	2,06	4,42	-0,09
XS0853682069	Snam 2012-2020 3,5%	111,98	5,51	5,28	3,03	3,07	3,12	0,18
XS0974375130	Telecom Italia 2013-2020 4,875%	114,44	—	9,03	6,68	4,02	4,25	1,34
XS1020952435	Telecom Italia 2014-2021 4,5%	114,03	—	6,54	7,10	4,06	3,94	1,31
XS0486101024	Telecom Italia 2010-2022 5,25%	113,89	6,51	9,29	4,75	5,07	4,60	2,56
XS0794393396	Telecom Italia 2012-2018 6,125%	112,88	5,25	6,24	3,98	2,05	5,42	0,81
XS0184373925	Telecom Italia 2004-2019 5,375%	111,94	5,25	6,84	5,12	2,06	4,80	0,69
XS0868458653	Telecom Italia 2012-2020 4%	109,06	6,03	7,64	5,11	3,06	3,66	1,37
XS0630463965	Telecom Italia 2011-2018 4,75%	108,51	4,69	5,84	3,61	1,10	4,37	0,25
XS0831389985	Telecom Italia 2012-2017 4,5%	105,25	4,01	4,53	2,74	1,02	4,27	0,20
XS0214965963	Telecom Italia 2005-2055 5,25%	102,10	—	12,60	5,46	38,08	5,14	5,12
IT0004991573	TerniEnergia 2014-2019 6,875%	79,00	—	—	-4,27	2,07	8,70	17,52
IT0005012247	Tesmec 2014-2021 6%	100,50	—	—	6,63	4,09	5,97	5,87
IT0005009524	TIP 2014-2020 4,75%	107,21	—	—	5,22	3,09	4,43	2,72
IT0005038382	Trevi Finanziaria Industriale 2014-2019 5,25%	95,60	—	—	1,62	3,00	5,49	6,88
XS1086778641	Twin Set - Simona Barbieri 2014-2019 Tasso Variabile	96,95	—	—	22,02	3,00	5,93	6,92
IT0004723489	UBI Banca 2011-2018 5,4% Amortizing	103,22	4,84	3,88	2,35	2,00	5,29	3,75

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
IT0004718489	UBI Banca 2011-2018 5,5% Amortizing	103,16	5,58	4,95	4,15	1,11	5,40	3,85
IT0004842370	UBI Banca 2012-2019 6% Amortizing	104,70	5,46	4,47	3,04	1,09	5,81	3,24
XS0618847775	UniCredit 2011-2021 6,125%	113,50	8,52	8,19	5,87	4,09	5,39	3,06
XS0849517650	UniCredit 2012-2022 6,95%	112,90	8,22	7,02	2,48	6,04	6,15	4,55
IT0004825029	UniCredit 2012-2018 5,65%	109,71	5,76	5,24	2,36	2,01	5,14	1,05
XS1014627571	UniCredit 2014-2021 3,25%	109,17	—	4,87	2,54	4,06	2,97	1,16
IT0004787476	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 6,1%	108,70	5,90	4,68	2,49	1,08	5,61	0,94
XS0367777884	UniCredit 2008-2018 6,7%	108,01	—	4,33	2,65	1,11	6,20	2,40
IT0004808421	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 5%	107,35	5,60	4,80	2,39	1,10	4,65	1,05
XS0322918565	UniCredit 2007-2017 5,75%	106,46	—	—	2,19	1,02	5,40	0,51
XS0863482336	UniCredit 2012-2018 3,375%	105,44	4,56	4,07	1,78	1,06	3,20	-0,17
IT0005022055	Unicredit 2014-2020 2,1% One-Step BancoPosta	104,40	—	—	4,00	4,01	2,01	0,99
XS1078760813	UniCredit 2014-2019 1,5%	102,71	—	—	2,15	2,11	1,46	0,58
XS1041042828	UGF 2014-2021 4,375%	108,48	—	—	3,52	4,08	4,03	2,43
XS1069508494	Veneto Banca 2014-2019 4%	93,53	—	—	-2,16	2,10	4,27	6,52
DI SOCIETÀ ESTERE								
NL0009289313	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal Euribor	121,96	7,68	7,84	1,77	3,06	6,92	1,81
NL0009054907	ABN AMRO Bank 2009-2019 5,5%	110,93	4,49	4,37	0,54	2,09	5,01	1,51

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
NL0009287614	ABN AMRO Bank 2009-2019 4,6%	110,64	5,45	5,58	1,33	3,05	4,22	1,44
XS1114159277	Adidas 2014-2026 2,25%	107,65	—	—	7,50	10,03	2,09	1,44
FR0011965177	Air France-KLM 2014-2021 3,875%	102,28	—	—	5,15	4,11	3,78	3,37
XS1084568762	ArcelorMittal 2014-2020 2,87%	96,77	—	—	-0,09	4,00	2,96	3,75
XS0584356942	Bank of America 2011-2026 5,25% Callable	117,76	8,18	7,99	4,09	9,07	4,45	3,08
IT0006712142	Barclays Bank 2010-2025 Scudo 7,5%	150,00	11,29	14,82	7,46	8,07	5,26	1,53
IT0006703208	Barclays Bank 2009-2019 6%	116,02	4,33	4,32	2,36	3,00	5,17	0,69
IT0006706326	Barclays Bank 2009-2019 Inflation Floored Notes	106,41	4,08	4,52	2,84	3,03	2,81	1,00
IT0006706318	Barclays Bank 2009-2019 Zero Coupon Notes	97,60	5,36	5,19	2,69	3,03	0,00	0,75
XS0653885961	BMW Finance 2011-2018 3,625%	107,32	2,38	2,33	1,63	1,06	3,37	-0,95
XS1015217703	BMW Finance 2014-2024 2,625%	113,94	—	3,87	2,29	7,06	2,30	0,72
XS0604641034	CNH Industrial Finance Europe 2011-2018 6,25%	108,00	4,34	3,60	3,30	1,08	5,78	1,42
XS1046851025	CNH Industrial Finance Europe 2014-2019 2,75%	102,80	—	—	3,72	2,08	2,67	1,68
XS1114452060	CNH Industrial Finance Europe 2014-2021 2,875%	101,69	—	—	3,07	5,02	2,82	2,52
DE000A11QSB8	Daimler 2014-2024 1,875%	107,72	—	—	2,24	8,00	1,74	0,87
XS0452187916	Enel Finance International 2009-2022 5%	126,87	9,56	9,63	4,75	6,02	3,94	0,58
XS0827692269	Enel Finance International 2012-2020 4,875%	117,21	7,34	7,46	3,16	3,08	4,15	0,20

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
XS0177089298	Enel Investment Holding 2003-2023 5,25%	131,38	10,58	10,56	5,72	7,03	3,99	0,78
XS0953215349	Fiat Chrysler Finance Europe 2013-2019 6,75%	112,35	—	6,61	4,39	3,03	6,00	2,76
XS0647264398	Fiat Chrysler Finance Europe 2011-2018 7,375%	109,51	7,85	5,14	3,56	2,00	6,73	2,50
XS1048568452	Fiat Chrysler Finance Europe 2014-2021 4,75%	107,70	—	—	4,60	4,08	4,41	2,97
XS1088515207	Fiat Chrysler Finance Europe 2014-2022 4,75%	107,62	—	—	4,78	6,00	4,41	3,33
XS0906420574	Fiat Chrysler Finance Europe 2013-2018 6,625%	106,76	—	4,80	3,20	1,08	6,20	2,52
FR0000471930	France Telecom 2003-2033 8,125%	190,80	10,93	15,60	9,66	16,07	4,25	1,76
XS0254356057	GE Capital European Funding 2006-2021 Tasso Variabile	99,12	—	—	0,45	4,10	0,22	0,40
FR0010014845	GIE PSA Trésorerie 2003-2033 6%	117,87	13,91	12,24	9,52	17,02	5,09	4,48
XS0496716282	Italcementi Finance 2010-2020 5,375%	117,07	8,13	7,40	4,75	3,08	4,59	0,71
XS0893201433	Italcementi Finance 2013-2018 6,125%	108,86	—	5,86	3,82	1,07	5,62	0,68
FR0011567940	Peugeot 2013-2019 6,5%	113,52	—	7,37	4,26	2,06	5,72	1,09
FR0011439975	Peugeot 2013-2018 7,375%	111,25	—	6,10	4,13	1,08	6,62	0,63
FR0011233451	Peugeot 2012-2017 5,625%	105,35	5,94	4,74	2,64	1,00	5,33	0,41
FR0011769090	Renault 2014-2021 3,125%	110,99	—	—	3,82	4,08	2,81	0,73
FR0011568963	Renault 2013-2018 3,625%	107,51	—	5,35	2,71	2,02	3,37	0,23
XS0161100515	Telecom Italia Finance 2003-2033 7,75%	133,67	10,45	14,20	5,47	16,06	5,79	4,76
XS0462999573	Telefonica Emisiones 2009-2019 4,693%	114,07	5,90	4,93	1,79	3,04	4,11	0,47

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			NL0009483825	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 5%	112,58		5,33	5,34
NL0009483833	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 8% Steepener	104,95	4,52	3,58	0,88	3,11	2,87	1,71
DE000A1R0410	Thyssenkrupp 2014-2019 3,125%	104,83	—	—	2,87	3,03	2,98	1,62
DE000UB2F5S4	UBS 2010-2017 4%	103,20	2,33	1,80	1,60	1,00	3,87	1,00
XS0731681556	Volkswagen International Finance 2012-2019 3,25%	107,95	2,88	3,08	0,91	2,06	3,01	0,14
XS0873793375	Volkswagen International Finance 2013-2020 2%	105,93	2,40	4,25	1,16	3,06	1,88	0,31
XS1014610254	Volkswagen Leasing 2014-2024 2,625%	109,64	—	2,85	0,68	7,06	2,39	1,28
DI ENTI INTERNAZIONALI								
IT0006527300	BEI 1999-2029 Step-Down	179,91	12,10	14,35	8,62	12,08	0,00	3,02
XS0505157965	BEI 2010-2030 4%	147,22	9,14	13,65	6,83	13,09	2,71	0,46
XS0427291751	BEI 2009-2025 4,5% Earns	141,14	7,04	9,95	5,14	9,03	3,18	0,06
XS0975634204	BEI 2013-2033 3%	137,17	—	16,04	7,14	17,03	2,18	0,71
XS0290050524	BEI 2007-2024 4,125%	133,37	6,23	9,20	4,05	7,09	3,09	-0,13
IT0006527052	BEI 1999-2019 Eurostability Bond	129,64	3,31	3,62	2,64	2,07	0,00	0,11
XS0807336077	BEI 2012-2025 2,75%	124,40	6,99	10,87	4,62	9,02	2,21	0,09
XS0544644957	BEI 2010-2022 3%	120,54	4,97	7,33	3,15	6,02	2,48	-0,26
XS0196448129	BEI 2004-2020 4,625%	119,21	3,05	4,28	1,55	3,09	3,87	-0,39

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			XS1023039545	BEI 2014-2024 2,125% EARNs	117,26		—	—
XS0676294696	BEI 2011-2021 2,75%	116,22	4,36	6,21	3,24	5,02	2,36	-0,33
XS0832628423	BEI 2012-2022 2,25%	115,86	5,17	7,84	3,73	6,03	1,94	-0,25
XS0942172296	BEI 2013-2023 2%	115,15	—	8,47	3,79	6,09	1,73	-0,21
XS0412826579	BEI 2009-2019 4,25%	113,19	2,11	2,87	1,06	2,09	3,75	-0,44
XS1107718279	BEI 2014-2026 1,25%	110,84	—	—	5,76	10,04	1,12	0,19
XS0918749622	BEI 2013-2021 1,375%	108,73	—	—	3,14	5,02	1,26	-0,29
XS0669743246	BEI 2011-2019 2,5%	107,98	2,12	2,80	0,81	2,08	2,31	-0,42
XS0903345220	BEI 2013-2020 1,5%	107,77	—	4,83	1,98	4,00	1,39	-0,40
XS0858366098	BEI 2012-2020 1,375%	107,57	—	—	2,19	4,02	1,27	-0,40
XS0308505055	BEI 2007-2017 4,75%	106,68	0,98	1,15	0,13	1,03	4,45	-0,40
XS0692728511	BEI 2011-2018 2,5%	106,68	1,69	2,42	0,68	2,03	2,35	-0,40
XS0878567394	BEI 2013-2018 1%	102,91	—	2,09	0,58	1,00	0,97	-0,42
XS0821238226	BEI 2012-2019 1,875%	102,57	1,84	3,64	2,97	3,03	1,83	1,08
IT0006526153	BERS 1998-2018 Step-Down Lifestyle	147,73	3,06	3,06	1,15	2,05	0,00	0,62
IT0006592981	BERS 2005-2025 CMS-Linked Global Floor	105,82	4,41	4,93	3,61	9,00	1,13	0,54
IT0006527516	Council of Europe Development Bank 1999-2019 Step-Down Premio Fisso al Rimborso	159,67	3,58	4,02	2,86	2,08	0,00	0,08
EU000A1G0AR0	EFSF 2012-2019 2,625%	108,62	2,58	2,98	1,08	2,10	2,41	-0,39
EU000A1G0BM9	EFSF 2014-2019 1,25%	104,26	—	—	0,96	2,06	1,19	-0,40
EU000A1G0A99	EFSF 2013-2018 1,25%	102,56	—	1,66	0,48	1,07	1,21	-0,34
EU000A1G4DN5	European Union 2012-2022 2,75%	117,85	—	—	3,02	5,09	2,33	-0,32

DATI E INDICI RELATIVI AD UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E

DATA AND INDICES ON SELECTED LISTED GOVERNMENT

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2016	
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015		immediato	effettivo
			EU000A1GVJX6	European Union 2011-2021 2,75%	116,14		4,01	6,03
IT0006525742	Inter-American Development Bank 1998-2018 Reverse Floater Capped	112,13	3,69	3,21	1,38	2,04	4,90	0,32

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2016

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2016

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2016 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2016 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2016		Rendimento immediato lordo al corso del 30-VI-2016 in %	Premio (+) o sconto (-) di convers. al 30-VI-2016 in %
			2-I-2013	2-I-2014	2-I-2015	anni	mesi		
			IT0004982770	CHL 2014-2018 6% Convertibile Amortizing	100,46	—	—		
IT0003872394	SIAS 2005-2017 2,625% Convertibile	101,95	4,31	3,12	1,11	1,00	2,57	43,98	

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO

LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI

AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
DI STATO								
Buoni del Tesoro Poliennali	816.455	68,4	847.241	68,9	905.946	69,5	1.000.678	72,6
Certificati di Credito del Tesoro	192.323	16,1	192.071	15,6	183.673	14,1	165.768	12,0
Buoni Ordinari del Tesoro	132.280	11,1	137.802	11,2	159.303	12,2	143.661	10,4
Certificati del Tesoro Zero-Coupon	47.169	3,9	47.314	3,8	49.484	3,8	63.949	4,6
Republic of Italy	6.439	0,5	4.905	0,4	4.905	0,4	4.905	0,4
Certificati di Credito del Tesoro in euroscudi	—	—	—	—	—	—	—	—
<i>Totale</i>	<i>1.194.666</i>	<i>100,0</i>	<i>1.229.334</i>	<i>100,0</i>	<i>1.303.311</i>	<i>100,0</i>	<i>1.378.960</i>	<i>100,0</i>
<i>% sul totale generale</i>		<i>53,7</i>		<i>50,8</i>		<i>48,7</i>		<i>43,9</i>
Comunali	46	*	40	*	34	*	28	*
ESTERI								
Regno dei Paesi Bassi	—	—	—	—	—	—	—	—
Regno del Belgio	—	—	—	—	—	—	—	—
Regno di Spagna	115.511	12,3	103.195	9,5	88.569	7,0	113.803	7,5
Repubblica Austriaca	870	0,1	870	0,1	870	0,1	870	0,1
Repubblica Ellenica	87.247	9,3	79.047	7,3	72.162	5,7	134.153	8,8
Repubblica Federale Tedesca	411.500	43,6	521.000	48,2	705.250	56,0	794.250	52,3
Repubblica Finlandese	—	—	—	—	—	—	—	—
Repubblica Francese	327.737	34,8	377.676	34,9	392.285	31,2	476.689	31,4
Repubblica Irlandese	—	—	—	—	—	—	—	—
Repubblica Polacca	—	—	—	—	—	—	—	—
Repubblica Portoghese	—	—	—	—	—	—	—	—
<i>Totale</i>	<i>942.865</i>	<i>100,0</i>	<i>1.081.788</i>	<i>100,0</i>	<i>1.259.137</i>	<i>100,0</i>	<i>1.519.765</i>	<i>100,0</i>
<i>% sul totale generale</i>		<i>42,4</i>		<i>44,7</i>		<i>46,9</i>		<i>48,4</i>
DI ENTI E SOCIETÀ								
2i Rete Gas	—	—	—	—	—	—	—	—
A2A	—	—	—	—	—	—	1.500	2,1
Acea	—	—	—	—	—	—	—	—
Acque del Basso Livenza	—	—	—	—	—	—	—	—
Acque del Chiampo	—	—	—	—	—	—	—	—
ADR - Aeroporti di Roma	—	—	—	—	—	—	—	—
Alerion	—	—	—	—	—	—	—	—
Alessandro Rosso Group	—	—	—	—	—	—	—	—
Alto Vicentino Servizi	—	—	—	—	—	—	—	—
Antin Solar Investments	—	—	—	—	—	—	—	—
ASI - Azienda Servizi Integrati	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Buoni del Tesoro Poliennali	1.092.292	74,4	1.164.812	76,4	1.223.551	77,7	1.308.015	78,5	1.397.456	81,9	1.441.280	83,3
Certificati di Credito del Tesoro	158.885	10,8	143.609	9,4	122.590	7,8	124.717	7,5	120.708	7,1	120.819	7,0
Buoni Ordinari del Tesoro	139.249	9,5	141.593	9,3	159.994	10,2	149.879	9,0	133.196	7,8	114.924	6,6
Certificati del Tesoro Zero-Coupon	72.639	4,9	69.183	4,5	64.642	4,1	79.507	4,8	50.163	2,9	47.701	2,8
Republic of Italy	4.905	0,3	4.905	0,3	4.905	0,3	4.905	0,3	4.905	0,3	4.905	0,3
Certificati di Credito del Tesoro in euroscudi	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<i>Totale</i>	<i>1.467.970</i>	<i>100,0</i>	<i>1.524.103</i>	<i>100,0</i>	<i>1.575.683</i>	<i>100,0</i>	<i>1.667.023</i>	<i>100,0</i>	<i>1.706.427</i>	<i>100,0</i>	<i>1.729.628</i>	<i>100,0</i>
<i>% sul totale generale</i>		<i>42,9</i>		<i>41,3</i>		<i>40,7</i>		<i>40,1</i>		<i>35,1</i>		<i>33,7</i>
Comunali	22	*	13	*	10	*	8	*	5	*	—	—
ESTERI												
Regno dei Paesi Bassi	—	—	—	—	—	—	—	—	83.913	3,6	193.869	7,9
Regno del Belgio	—	—	—	—	—	—	113.941	6,6	270.738	11,5	262.659	10,7
Regno di Spagna	134.792	8,5	174.980	10,9	162.272	10,3	217.080	12,6	389.633	16,6	397.509	16,2
Repubblica Austriaca	36.850	2,3	90.719	5,6	90.719	5,7	127.825	7,4	157.011	6,7	151.165	6,2
Repubblica Ellenica	145.433	9,2	136.623	8,5	176.281	11,1	168.301	9,7	160.301	6,8	160.301	6,5
Repubblica Federale Tedesca	713.750	45,0	664.500	41,2	600.500	37,9	545.500	31,6	544.250	23,2	511.750	20,9
Repubblica Finlandese	—	—	—	—	—	—	—	—	69.003	2,9	72.004	2,9
Repubblica Francese	555.311	35,0	545.099	33,8	553.285	35,0	554.305	32,1	539.250	23,0	504.832	20,6
Repubblica Irlandese	—	—	—	—	—	—	—	—	51.045	2,2	96.016	3,9
Repubblica Polacca	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	14.925	0,6
Repubblica Portoghese	—	—	—	—	—	—	—	—	82.615	3,5	83.463	3,4
<i>Totale</i>	<i>1.586.136</i>	<i>100,0</i>	<i>1.611.920</i>	<i>100,0</i>	<i>1.583.057</i>	<i>100,0</i>	<i>1.726.952</i>	<i>100,0</i>	<i>2.347.760</i>	<i>100,0</i>	<i>2.448.493</i>	<i>100,0</i>
<i>% sul totale generale</i>		<i>46,4</i>		<i>43,6</i>		<i>40,9</i>		<i>41,5</i>		<i>48,3</i>		<i>47,7</i>
DI ENTI E SOCIETÀ												
2i Rete Gas	—	—	—	—	—	—	—	—	1.350	0,7	1.350	0,8
A2A	1.500	1,5	1.500	0,9	2.250	1,0	2.750	1,2	2.750	1,5	3.050	1,8
Acea	—	—	—	—	—	—	600	0,3	1.200	0,6	1.200	0,7
Acque del Basso Livenza	—	—	—	—	—	—	—	—	14	*	14	*
Acque del Chiampo	—	—	—	—	—	—	—	—	13	*	13	*
ADR - Aeroporti di Roma	—	—	—	—	—	—	600	0,3	600	0,3	600	0,3
Alerion	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	130	0,1
Alessandro Rosso Group	—	—	—	—	—	—	4	*	4	*	4	*
Alto Vicentino Servizi	—	—	—	—	—	—	—	—	18	*	18	*
Antin Solar Investments	—	—	—	—	—	—	—	—	85	*	83	*
ASI - Azienda Servizi Integrati	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015			
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%		
Asja Ambiente Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	12	*	
Assicurazioni Generali.....	—	—	—	—	—	—	1.750	2,4	1.750	1,8	2.500	1,5	2.500	1,1	2.500	1,1	3.000	1,6	3.000	1,7		
Atlantia..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	1.500	2,1	3.000	3,0	3.000	1,8	5.750	2,6	6.500	2,9	6.500	3,5	6.500	3,8		
Autostade per l'Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.600	1,5	
Banca Adria CC del Delta.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	40	*	40	*	40	*	40	*	—	—
Banca Agricola Popolare di Ragusa.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	43	*	43	*	43	*	43	*	—	—
Banca Alpi Marittime CC Carrù.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	48	*	48	*	48	*	48	*	—	—
Banca Alto Vicentino CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	13	*	13	*	13	*	13	*	—	—
Banca Apulia.....	120	0,2	100	0,2	175	0,4	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
Banca Area Pratese CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	13	*	13	*	13	*	13	*	—	—
Banca Atestina CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*	9	*	9	*	9	*	—	—
Banca Carige.....	145	0,2	623	1,0	611	1,3	528	0,7	500	0,5	2.135	1,3	2.835	1,3	2.085	0,9	1.625	0,9	825	0,5	—	—
Banca Carime..... ²⁾	130	0,2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
Banca Cassa di Risparmio di Savigliano.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	40	*	40	*	—	—	—	—	—	—
Banca Centro Emilia CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	23	*	23	*	—	—	—	—	—	—
Banca CR Asti - Cassa di Risparmio di Asti.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	340	0,2	340	0,2	340	0,2	340	0,2	—	—
Banca Cras CC - Chianciano Terme-Costa Etrusca-Sovicille.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	38	*	38	*	38	*	38	*	8	*
Banca Cremonese CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	40	*	40	*	—	—	—	—	—	—
Banca dei Sibillini - CC di Casavecchia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	—	—	—	—	—	—
Banca del Centroveneto CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	45	*	45	*	—	—	—	—	—	—
Banca del Cilento e Lucania Sud CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*	15	*	—	—
Banca del Lavoro e del Piccolo Risparmio.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	20	*	—	—
Banca del Sud.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	5	*	—	—
Banca del Valdarno CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	45	*	45	*	—	—	—	—	—	—
Banca della Bergamasca CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	35	*	35	*	35	*	35	*	—	—
Banca della Marea CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	90	*	90	*	—	—	—	—	—	—
Banca della Maremma.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	20	*	—	—
Banca della Tuscia CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*	4	*	4	*	4	*	—	—
Banca della Valpolicella CC di Marano.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	—	—	—	—	—	—
Banca delle Marche.....	—	—	—	—	—	—	—	—	650	0,7	1.150	0,7	1.500	0,7	1.000	0,4	1.000	0,5	300	0,2	—	—
Banca dell'Elba CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5.100	2,3	5.100	2,3	5.100	2,7	—	—	—	—
Banca di Ancona CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*	9	*	9	*	9	*	—	—
Banca di Anghiari e Stia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Bedizzole Turano Valvestino CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	53	*	53	*	53	*	53	*	—	—
Banca di Bologna CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	120	0,1	120	0,1	90	*	—	—	—	—
Banca di Capranica CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	10	*	10	*	—	—
Banca di Carnia e Gemonese CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Cascina CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	10	*	10	*	—	—
Banca di Cavola e Sassuolo CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	36	*	36	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Cesena - CC di Cesena e Ronta.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	50	*	50	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Cividale.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	150	0,1	150	0,1	150	0,1	150	0,1	50	*
Banca di Forlì CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	60	*	60	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Mantignana e di Perugia CC Umbro.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Monastier e del Sile.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	100	0,1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Pesaro CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	28	*	28	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Pescaia CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	12	*	12	*	—	—	—	—	—	—
Banca di Pistoia CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*	30	*	30	*	—	—
Banca di Rimini CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	32	*	32	*	32	*	32	*	—	—

1) Già Autostrade. - 2) Gruppo UBI Banca.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Banca di Ripatransone CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Romano e S. Caterina CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Saturnia e Costa d'Argento CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Teramo di CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Udine CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Viterbo CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Etruria.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Fideuram..... ¹⁾	200	0,3	200	0,3	200	0,4	—	—
Banca Ifis.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca IMI..... ¹⁾²⁾	251	0,4	123	0,2	301	0,6	1.849	2,6
Banca Malatestiana CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Monte dei Paschi di Siena..... ³⁾	1.245	1,9	1.206	2,0	720	1,5	1.418	2,0
Banca Nazionale del Lavoro..... ³⁾⁴⁾	4.248	6,5	3.290	5,5	2.784	5,8	1.880	2,6
Banca Picena Truentina CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare del Frusinate.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare dell'Alto Adige.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare dell'Emilia Romagna.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Bari.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Cividale.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Lajatico.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Marostica.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Puglia e Basilicata.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Sondrio.....	—	—	—	—	—	—	1.000	0,6
Banca Popolare di Spoleto.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Vicenza.....	—	—	—	—	—	—	2.000	1,2
Banca Popolare Pugliese.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare Valconca della Provincia di Rimini.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Privata Leasing.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Reggiana CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca San Biagio del Veneto Orientale BCC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca San Giorgio Quinto Valle Agno CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Santo Stefano CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Suasa CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Valsabbina.....	—	—	—	—	—	—	150	0,1
Banca Veronese CC di Concamarise.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Bancasciano CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banco di Credito P. Azzoaglio.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banco Popolare..... ⁵⁾	1.182	1,8	118	0,2	118	—	2.118	2,9
BCC Abruzzese - Cappelle Tavo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Crediveneto - CC Interprovinciale Veneto.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC dei Castelli Romani.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC dei Comuni Cilentani.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC del Carso.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC del Friuli Centrale.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC del Garda - Banca di CC Colli Morenici del Garda.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC del Metauro.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC del Polesine.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC del Velino.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC del Veneziano.....	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Banca di Ripatransone CC.....	—	—	—	—	14	*	14	*	—	—	—	—
Banca di Romano e S. Caterina CC.....	—	—	—	—	21	*	21	*	—	—	—	—
Banca di Saturnia e Costa d'Argento CC.....	—	—	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—
Banca di Teramo di CC.....	—	—	—	—	6	*	6	*	6	*	—	—
Banca di Udine CC.....	—	—	—	—	14	*	14	*	—	—	—	—
Banca di Viterbo CC.....	—	—	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—
Banca Etruria.....	—	—	—	—	—	—	—	—	170	0,1	170	0,1
Banca Fideuram..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Ifis.....	—	—	—	—	207	0,1	207	0,1	—	—	—	—
Banca IMI..... ¹⁾²⁾	3.696	3,7	3.820	2,2	3.893	1,7	3.983	1,8	3.086	1,7	1.589	0,9
Banca Malatestiana CC.....	—	—	—	—	100	*	100	*	—	—	—	—
Banca Monte dei Paschi di Siena..... ³⁾	2.411	2,4	15.569	9,1	8.200	3,7	5.755	2,6	5.034	2,7	3.838	2,2
Banca Nazionale del Lavoro..... ³⁾⁴⁾	1.748	1,8	901	0,5	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Picena Truentina CC.....	—	—	—	—	35	*	35	*	35	*	—	—
Banca Popolare del Frusinate.....	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	—	—
Banca Popolare dell'Alto Adige.....	—	—	—	—	160	0,1	160	0,1	160	0,1	—	—
Banca Popolare dell'Emilia Romagna.....	—	—	—	—	750	0,4	1.250	0,6	1.250	0,6	—	—
Banca Popolare di Bari.....	—	—	—	—	420	0,2	420	0,2	—	—	—	—
Banca Popolare di Cividale.....	—	—	—	—	100	0,1	230	0,1	230	0,1	230	0,1
Banca Popolare di Lajatico.....	—	—	—	—	43	*	43	*	—	—	—	—
Banca Popolare di Marostica.....	—	—	—	—	50	*	50	*	—	—	—	—
Banca Popolare di Puglia e Basilicata.....	—	—	—	—	89	*	89	*	—	—	—	—
Banca Popolare di Sondrio.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Spoleto.....	—	—	—	—	1.000	0,6	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Vicenza.....	—	—	—	—	—	—	210	0,1	210	0,1	70	*
Banca Popolare Pugliese.....	—	—	—	—	2.000	1,2	6.550	2,9	6.450	2,9	1.650	0,9
Banca Popolare Valconca della Provincia di Rimini.....	—	—	—	—	—	—	168	0,1	168	0,1	—	—
Banca Privata Leasing.....	—	—	—	—	—	—	50	*	50	*	50	*
Banca Reggiana CC.....	—	—	—	—	—	—	65	*	65	*	65	*
Banca San Biagio del Veneto Orientale BCC.....	—	—	—	—	—	—	60	*	60	*	—	—
Banca San Giorgio Quinto Valle Agno CC.....	—	—	—	—	—	—	32	*	32	*	—	—
Banca Santo Stefano CC.....	—	—	—	—	—	—	65	*	65	*	65	*
Banca Suasa CC.....	—	—	—	—	—	—	70	*	70	*	—	—
Banca Valsabbina.....	—	—	—	—	—	—	18	*	18	*	—	—
Banca Veronese CC di Concamarise.....	—	—	—	—	150	0,1	150	0,1	150	0,1	—	—
Bancasciano CC.....	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	—	—
Banco di Credito P. Azzoaglio.....	—	—	—	—	—	—	21	*	21	*	21	*
Banco Popolare..... ⁵⁾	5.644	5,7	11.312	6,6	11.942	5,4	10.365	4,6	10.589	5,7	9.489	5,5
BCC Abruzzese - Cappelle Tavo.....	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*	7	*
BCC Crediveneto - CC Interprovinciale Veneto.....	—	—	—	—	—	—	50	*	50	*	30	*
BCC dei Castelli Romani.....	—	—	—	—	—	—	6	*	6	*	6	*
BCC dei Comuni Cilentani.....	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	—	—
BCC del Carso.....	—	—	—	—	—	—	24	*	24	*	—	—
BCC del Friuli Centrale.....	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	—	—
BCC del Garda - Banca di CC Colli Morenici del Garda.....	—	—	—	—	—	—	104	*	104	*	104	0,1
BCC del Metauro.....	—	—	—	—	—	—	39	*	39	*	—	—
BCC del Polesine.....	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*
BCC del Velino.....	—	—	—	—	—	—	4	*	4	*	4	*
BCC del Veneziano.....	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*	30	*

1) Gruppo Intesa Sanpaolo. - 2) Già Caboto. Gli importi indicati includono quelli relativi a Banca IMI, incorporata nel IX-2007. - 3) Sono inclusi i titoli di sezioni di credito speciale successivamente trasformate in società per azioni o confluite in altri istituti di credito. - 4) Gruppo BNP Paribas. Già BNL Progetto. Si tratta della società conferitaria del ramo d'azienda formato dalle attività e passività relative al settore "banca commerciale" di Banca Nazionale del Lavoro, incorporata in BNP Paribas SA nel IX-2007. Gli importi indicati

includono quelli relativi a Banca Nazionale del Lavoro ante fusione. - 5) Gli importi indicati includono quelli relativi alla Banca Popolare Italiana (1.064 nel 2006) e ad Efibanca (118 nel 2006, 2007, 2008, 2009, 2010 e 2011). Banco Popolare di Verona e Novara e Banca Popolare Italiana si sono fuse per unione nel VII-2007, a costituire Banco Popolare. Banca Italease è stata acquisita nel III-2010 a seguito di opa. Efibanca è stata incorporata nell'XI-2011.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
BCC della Bassa Friulana.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC della Valle del Trigno.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC dell'Alta Brianza.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC delle Prealpi.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Alba, Langhe e Roero.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Arborea.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Barlassina.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Basiliano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Busto Garolfo e Buguggiate.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Capaccio Paestum.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Carate Brianza.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Caravaggio.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Cartura.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Casalgrasso e Sant'Albano Stura.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Castagneto Carducci.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Castel Goffredo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Castenaso.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Castiglione Messer Raimondo e Pianella.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Cernusco sul Naviglio.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Cherasco.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Corinaldo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Doberdò e Savogna.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Falconara Marittima.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Fano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Filottrano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Fiuggi.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Fiumicello ed Aiello del Friuli.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Formacette.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Gatteo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Ghisalba.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Gradara.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Impruneta.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Inzago.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Lesmo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Manzano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Marcon.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Masiano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Montecorvino Rovella.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Montepulciano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Ostra e Morro d'Alba.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Pachino.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Pergola.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Pianfei e Rocca De' Baldi.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Piove di Sacco.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Pitigliano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Pompiano e della Franciacorta.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Pontassieve.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Pratola Peligna.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Sala di Cesenatico.....	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
BCC della Bassa Friulana.....	—	—	—	—	20	*	20	*	10	*	—	—
BCC della Valle del Trigno.....	—	—	—	—	5	*	5	*	—	—	—	—
BCC dell'Alta Brianza.....	—	—	—	—	30	*	30	*	30	*	—	—
BCC delle Prealpi.....	—	—	—	—	102	*	102	*	—	—	—	—
BCC di Alba, Langhe e Roero.....	—	—	—	—	100	*	100	*	—	—	—	—
BCC di Arborea.....	—	—	—	—	22	*	22	*	9	*	—	—
BCC di Barlassina.....	—	—	—	—	47	*	47	*	47	*	—	—
BCC di Basiliano.....	—	—	—	—	22	*	22	*	—	—	—	—
BCC di Busto Garolfo e Buguggiate.....	—	—	—	—	43	*	43	*	—	—	—	—
BCC di Capaccio Paestum.....	—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—
BCC di Carate Brianza.....	—	—	—	—	150	0,1	150	0,1	—	—	—	—
BCC di Caravaggio.....	—	—	—	—	32	*	32	*	32	*	—	—
BCC di Cartura.....	—	—	—	—	21	*	21	*	—	—	—	—
BCC di Casalgrasso e Sant'Albano Stura.....	—	—	—	—	39	*	39	*	—	—	—	—
BCC di Castagneto Carducci.....	—	—	—	—	42	*	42	*	—	—	—	—
BCC di Castel Goffredo.....	—	—	—	—	23	*	23	*	—	—	—	—
BCC di Castenaso.....	—	—	—	—	18	*	18	*	—	—	—	—
BCC di Castiglione Messer Raimondo e Pianella.....	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	—	—
BCC di Cernusco sul Naviglio.....	—	—	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—
BCC di Cherasco.....	—	—	—	—	58	*	58	*	18	*	—	—
BCC di Corinaldo.....	—	—	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—
BCC di Doberdò e Savogna.....	—	—	—	—	6	*	6	*	—	—	—	—
BCC di Falconara Marittima.....	—	—	—	—	22	*	22	*	22	*	—	—
BCC di Fano.....	—	—	—	—	44	*	44	*	—	—	—	—
BCC di Filottrano.....	—	—	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—
BCC di Fiuggi.....	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	—	—
BCC di Fiumicello ed Aiello del Friuli.....	—	—	—	—	11	*	11	*	—	—	—	—
BCC di Formacette.....	—	—	—	—	125	0,1	125	0,1	—	—	—	—
BCC di Gatteo.....	—	—	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—
BCC di Ghisalba.....	—	—	—	—	45	*	45	*	45	*	—	—
BCC di Gradara.....	—	—	—	—	31	*	31	*	—	—	—	—
BCC di Impruneta.....	—	—	—	—	18	*	18	*	—	—	—	—
BCC di Inzago.....	—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—
BCC di Lesmo.....	—	—	—	—	9	*	9	*	—	—	—	—
BCC di Manzano.....	—	—	—	—	30	*	30	*	—	—	—	—
BCC di Marcon.....	—	—	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—
BCC di Masiano.....	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*	—	—
BCC di Montecorvino Rovella.....	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	—	—
BCC di Montepulciano.....	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	—	—
BCC di Ostra e Morro d'Alba.....	—	—	—	—	23	*	23	*	—	—	—	—
BCC di Pachino.....	—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—
BCC di Pergola.....	—	—	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—
BCC di Pianfei e Rocca De' Baldi.....	—	—	—	—	17	*	17	*	—	—	—	—
BCC di Piove di Sacco.....	—	—	—	—	50	*	50	*	—	—	—	—
BCC di Pitigliano.....	—	—	—	—	9	*	9	*	—	—	—	—
BCC di Pompiano e della Franciacorta.....	—	—	—	—	200	0,1	200	0,1	—	—	—	—
BCC di Pontassieve.....	—	—	—	—	30	*	30	*	15	*	—	—
BCC di Pratola Peligna.....	—	—	—	—	22	*	22	*	—	—	—	—
BCC di Sala di Cesenatico.....	—	—	—	—	44	*	44	*	—	—	—	—

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
BCC di San Giorgio e Meduno	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di San Giovanni Rotondo	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di San Marco dei Cavoti e del Sannio	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di San Marzano di San Giuseppe	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Sant'Elena	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Scafati e Cetara	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Sesto San Giovanni	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Signa	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Sorisole e Lepreno	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Spello e Bettona	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Staranzano e Villesse	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Triuggio e della Valle del Lambro	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Vergato	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC di Vignole	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Monte Pruno di Roscigno e di Laurino	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Picena	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Pordenonese	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Sangro Teatina di Atessa	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Valle Seriana	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Valmarecchia	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Vicentino - Pojana Maggiore	—	—	—	—	—	—	—	—
BDM-MCC - Banca del Mezzogiorno-MedioCredito Centrale	966	1,5	889	1,5	804	1,7	753	1,0
Bene Banca - BCC di Bene Vagienna	—	—	—	—	—	—	—	—
BIM Gestione Servizi Pubblici	—	—	—	—	—	—	—	—
BPM	—	—	—	—	—	—	—	—
BPRM - Banca della Provincia di Macerata	—	—	—	—	—	—	—	—
Building Energy	—	—	—	—	—	—	—	—
Buscaini Angelo	—	—	—	—	—	—	—	—
Buzzi Unicem	—	—	—	—	—	—	—	—
Carichieti - Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti	—	—	—	—	—	—	—	—
Carifermo - Cassa di Risparmio di Fermo	—	—	—	—	—	—	—	—
Cartiere Villa Lagarina	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Centrale BCC del Nord Est	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Bolzano	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Bra	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Cento	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Cesena	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Ferrara	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Ravenna	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Volterra	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Padana BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen Castelrotto	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen della Valle Isarco	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen di Brunico	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen di Scena	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen Nova Levante	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen Nova Ponente - Aldino	—	—	—	—	—	—	—	—

31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
—	—	—	—	24	*	24	*	—	—	—	—
—	—	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—
—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	—	—
—	—	—	—	9	*	9	*	9	*	—	—
—	—	—	—	42	*	42	*	—	—	—	—
—	—	—	—	7	*	7	*	7	*	—	—
—	—	—	—	29	*	29	*	9	*	—	—
—	—	—	—	35	*	35	*	35	*	—	—
—	—	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—
—	—	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—
—	—	—	—	12	*	12	*	—	—	—	—
—	—	—	—	30	*	30	*	—	—	—	—
—	—	—	—	7	*	7	*	—	—	—	—
—	—	—	—	28	*	28	*	—	—	—	—
—	—	—	—	12	*	12	*	—	—	—	—
—	—	—	—	34	*	34	*	34	*	—	—
—	—	—	—	60	*	60	*	—	—	—	—
—	—	—	—	9	*	9	*	—	—	—	—
—	—	—	—	14	*	14	*	14	*	—	—
—	—	—	—	25	*	25	*	25	*	—	—
—	—	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—
753	0,8	652	0,4	652	0,3	498	0,2	—	—	—	—
—	—	—	—	37	*	37	*	37	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*
—	—	3.900	2,3	3.150	1,4	2.650	1,2	2.704	1,4	2.650	1,5
—	—	—	—	10	*	10	*	10	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*
—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	350	0,2
—	—	—	—	180	0,1	180	0,1	180	0,1	60	*
—	—	—	—	70	*	70	*	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*
—	—	—	—	150	0,1	150	0,1	—	—	—	—
—	—	—	—	160	0,1	160	0,1	160	0,1	—	—
—	—	—	—	600	0,3	600	0,3	200	0,1	—	—
—	—	—	—	50	*	50	*	—	—	—	—
—	—	150	0,1	90	*	90	*	—	—	—	—
—	—	—	—	300	0,1	300	0,1	—	—	—	—
—	—	375	0,2	375	0,2	375	0,2	375	0,2	125	0,1
—	—	—	—	270	0,1	270	0,1	—	—	—	—
—	—	—	—	100	*	100	*	—	—	—	—
—	—	—	—	125	0,1	125	0,1	125	0,1	—	—
—	—	—	—	20	*	20	*	—	—	—	—
—	—	—	—	13	*	13	*	13	*	—	—
—	—	—	—	37	*	37	*	—	—	—	—
—	—	—	—	18	*	18	*	18	*	—	—
—	—	—	—	6	*	6	*	—	—	—	—
—	—	—	—	6	*	6	*	—	—	—	—

1) Gruppo Poste Italiane. - 2) Già MCC - Mediocredito Centrale.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Cassa Raiffeisen Val Badia	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen Villabassa	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Raiffeisen Wippital	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Adamello - Brenta BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Alta Valdisole e Pejo BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Alta Vallagarina BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Alto Garda - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Bassa Vallagarina BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale BCC di Treviglio	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Centro Valsugana BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale della Bassa Valsugana - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Aldeno e Cadine BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Brentonico BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Fiemme BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Folgaria BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Levico Terme - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Lizzana - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Mezzocorona BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Pergine BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Rabbi e Caldes BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Rovereto - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Tassullo e Nanno - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Trento - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale di Tuenno - Val di Non - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana dell'Agro Pontino BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana di Binasco - CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana di Boves - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana di Brendola CC ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana di Cantù BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana di Roana - CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana di Vestenanova	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale ed Artigiana S. Giuseppe CC Camerano	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Lavis - Valle di Cembra - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Mori - Val di Gresta - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Pinetana Fornace e Seregnano BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Pinzolo BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Renon	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Val di Fassa e Agordino - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cassa Rurale Valli di Primiero e Vanoi - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
CC - Cassa Rurale ed Artigiana di Paliano	—	—	—	—	—	—	—	—
CC dell'Adda e del Cremasco	—	—	—	—	—	—	—	—
CC Mediocriti	—	—	—	—	—	—	—	—
CDP ²⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Centro Leasing Banca ³⁾	—	—	90	0,2	90	0,2	90	0,1
Centro Veneto Servizi	—	—	—	—	—	—	—	—
Centromarca Banca CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Cerved Group	—	—	—	—	—	—	—	—
Chiantibanca BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
CMC di Ravenna	—	—	—	—	—	—	—	—

31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
—	—	—	—	25	*	25	*	25	*	—	—
—	—	—	—	7	*	7	*	7	*	—	—
—	—	—	—	15	*	15	*	15	*	—	—
—	—	—	—	24	*	24	*	—	—	—	—
—	—	—	—	19	*	19	*	—	—	—	—
—	—	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—
—	—	—	—	62	*	62	*	—	—	—	—
—	—	—	—	40	*	40	*	—	—	—	—
—	—	—	—	87	*	87	*	—	—	—	—
—	—	—	—	13	*	13	*	13	*	—	—
—	—	—	—	8	*	8	*	—	—	—	—
—	—	—	—	32	*	32	*	—	—	—	—
—	—	—	—	5	*	5	*	—	—	—	—
—	—	—	—	30	*	30	*	—	—	—	—
—	—	—	—	16	*	16	*	16	*	—	—
—	—	—	—	8	*	8	*	8	*	—	—
—	—	—	—	9	*	9	*	—	—	—	—
—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—
—	—	—	—	28	*	28	*	—	—	—	—
—	—	—	—	7	*	7	*	—	—	—	—
—	—	—	—	16	*	16	*	—	—	—	—
—	—	—	—	5	*	5	*	—	—	—	—
—	—	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—
—	—	—	—	21	*	21	*	—	—	—	—
—	—	—	—	6	*	6	*	6	*	—	—
—	—	—	—	33	*	33	*	—	—	—	—
—	—	—	—	5	*	5	*	—	—	—	—
—	—	—	—	57	*	57	*	—	—	—	—
—	—	—	—	75	*	75	*	—	—	—	—
—	—	—	—	10	*	10	*	10	*	—	—
—	—	—	—	11	*	11	*	—	—	—	—
—	—	—	—	21	*	21	*	21	*	—	—
—	—	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—
—	—	—	—	14	*	14	*	—	—	—	—
—	—	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—
—	—	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—
—	—	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—
—	—	—	—	400	0,2	400	0,2	—	—	—	—
—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—
—	—	—	—	7	*	7	*	—	—	—	—
—	—	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—
—	—	—	—	19	*	19	*	19	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	2.550	1,4	5.550	3,2
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	29	*	29	*
—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	—	—
—	—	—	—	—	—	780	0,3	530	0,3	530	0,3
—	—	—	—	106	*	106	*	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	300	0,2	300	0,2

1) Gli importi indicati includono quelli relativi a B.C.C. di Campiglia dei Berici (7,5 nel 2012 e nel 2013), incorporata nel 1-2014. - 2) Gli importi indicati includono quelli relativi alla CDP (2.500 nel 2014 e 4.800 nel 2015) e alla CDP RETI (750 nel 2015). - 3) Gruppo Intesa Sanpaolo.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
CMD - Costruzioni Motori Diesel	—	—	—	—	—	—	—	—
Coesia	—	—	—	—	—	—	—	—
Cogemat	—	—	—	—	—	—	—	—
Coleman	—	—	—	—	—	—	—	—
Corvallis Holding	—	—	—	—	—	—	—	—
Coswell	—	—	—	—	—	—	—	—
CRA di Treviso - Cassa Rurale ed Artigiana di Treviso CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Credem	907	1,4	459	0,8	368	0,8	366	0,5
Credifriuli - CC Friuli	—	—	—	—	—	—	—	—
Credito Trevigiano - BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Credito Valdinievole BCC di Montecatini Terme e Bientina	—	—	—	—	—	—	—	—
Credito Valtellinese	—	—	—	—	—	—	—	—
Crediumbria BCC	—	—	—	—	—	—	—	—
Dalmine	—	—	—	—	—	—	—	—
Davide Campari Milano	—	—	—	—	—	—	—	—
Dedagroup	—	—	—	—	—	—	—	—
Dexia Crediop	4.092	6,3	4.828	8,1	5.859	12,2	5.165	7,2
Dynamica Retail	—	—	—	—	—	—	—	—
Edison	—	—	—	—	—	—	1.400	1,9
Efibanca	—	—	—	—	—	—	—	—
EGEA - Ente Gestione Energia e Ambiente	—	—	—	—	—	—	—	—
EMIL Banca CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Enel	1.000	1,5	3.300	5,5	3.300	6,9	4.800	6,7
Enerventi	—	—	—	—	—	—	—	—
Eni	—	—	—	—	—	—	5.000	6,9
ESTRA	—	—	—	—	—	—	—	—
ETRA - Energia Territorio Risorse Ambientali	—	—	—	—	—	—	—	—
Etrion	—	—	—	—	—	—	—	—
Eurotranciatura	—	—	—	—	—	—	—	—
Exor	—	—	—	—	—	—	—	—
Exprivia Health It	—	—	—	—	—	—	—	—
FAB Srl	—	—	—	—	—	—	—	—
Ferrarini	—	—	—	—	—	—	—	—
Ferrovie dello Stato	—	—	—	—	—	—	—	—
Filca Cooperative	—	—	—	—	—	—	—	—
Finanziaria Internazionale Holding	—	—	—	—	—	—	—	—
Finmeccanica	—	—	—	—	—	—	—	—
First Capital	—	—	—	—	—	—	—	—
Fnm	—	—	—	—	—	—	—	—
FRI-EL Green Power Srl	—	—	—	—	—	—	—	—
Gamenet	—	—	—	—	—	—	—	—
Geodata Engineering	—	—	—	—	—	—	—	—
Global System International	—	—	—	—	—	—	—	—
Gpi	—	—	—	—	—	—	—	—
Gruppo Bancario Iccrea	—	—	—	—	—	—	—	—
Gruppo PSC	—	—	—	—	—	—	—	—
Hera	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
CMD - Costruzioni Motori Diesel	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Coesia	—	—	—	—	—	—	—	—	100	0,1	100	0,1
Cogemat	—	—	—	—	—	—	—	—	51	*	22	*
Coleman	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*
Corvallis Holding	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*
Coswell	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*
CRA di Treviso - Cassa Rurale ed Artigiana di Treviso CC	—	—	—	—	18	*	18	*	—	—	—	—
Credem	296	0,3	1.026	0,6	956	0,4	886	0,4	354	0,2	252	0,1
Credifriuli - CC Friuli	—	—	—	—	39	*	39	*	—	—	—	—
Credito Trevigiano - BCC	—	—	—	—	41	*	41	*	41	*	—	—
Credito Valdinievole BCC di Montecatini Terme e Bientina	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*	—	—
Credito Valtellinese	—	—	—	—	500	0,3	1.500	0,7	1.500	0,7	—	—
Crediumbria BCC	—	—	—	—	31	*	31	*	—	—	—	—
Dalmine	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Davide Campari Milano	—	—	—	—	400	0,2	400	0,2	400	0,2	1.000	0,6
Dedagroup	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*
Dexia Crediop	4.614	4,7	5.979	3,5	5.177	2,3	4.881	2,2	4.204	2,2	2.859	1,7
Dynamica Retail	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*
Edison	1.800	1,8	1.800	1,1	1.800	0,8	1.800	0,8	1.100	0,6	600	0,3
Efibanca	—	—	—	—	118	0,1	41	*	—	—	—	—
EGEA - Ente Gestione Energia e Ambiente	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*
EMIL Banca CC	—	—	—	—	114	0,1	114	0,1	—	—	—	—
Enel	8.800	8,9	10.300	6,0	12.300	5,5	11.550	5,1	11.400	6,1	9.100	5,3
Enerventi	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*	8	*
Eni	7.000	7,1	11.075	6,5	12.825	5,8	13.225	5,9	14.225	7,6	13.975	8,1
ESTRA	—	—	—	—	—	—	—	—	50	*	50	*
ETRA - Energia Territorio Risorse Ambientali	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*
Etrion	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	35	*
Eurotranciatura	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*
Exor	—	—	—	—	—	—	—	—	940	0,5	1.690	1,0
Exprivia Health It	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	4	*
FAB Srl	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	7	*
Ferrarini	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*
Ferrovie dello Stato	—	—	—	—	—	—	750	0,3	1.350	0,7	1.350	0,8
Filca Cooperative	—	—	—	—	—	—	12	*	16	*	16	*
Finanziaria Internazionale Holding	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	5	*
Finmeccanica	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,3	500	0,3
First Capital	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*
Fnm	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	58	*
FRI-EL Green Power Srl	—	—	—	—	—	—	—	—	12	*	12	*
Gamenet	—	—	—	—	—	—	200	0,1	200	0,1	200	0,1
Geodata Engineering	—	—	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*
Global System International	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*
Gpi	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	12	*
Gruppo Bancario Iccrea	—	—	—	—	940	0,6	940	0,4	1.440	0,6	500	0,3
Gruppo PSC	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*
Hera	—	—	—	—	—	—	500	0,2	1.000	0,5	1.000	0,6

1) Gruppo Tenaris. - 2) Già Crediop. - 3) Gli importi indicati includono quelli relativi all'Iccrea Banca (290 nel 2011 e nel 2012, 790 nel 2013 e 500 nel 2014 e nel 2015) e all'Iccrea Bancalmpresa (650 nel 2011, nel 2012 e nel 2013).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015			
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%		
Iacobucchi HF Aerospace.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
IBL Banca - Istituto Bancario del Lavoro.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	62	*	62	*	62	*	62	*	—	*
Imi Fabi.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*	7	*
Indesit Company.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	300	0,1	300	0,2	300	0,2	300	0,2
Industrial.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	27	*	
INglass.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*	8	*
Innovatec.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	10	*
Intek Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	102	0,1
Interbanca 15).....	212	0,3	176	0,3	114	0,2	62	0,1	62	0,1	62	*	62	*	62	*	62	*	62	*	62	*
Intesa Sanpaolo 16) 17).....	16.484	25,2	13.446	22,6	8.493	17,6	8.627	12,0	15.824	16,0	32.570	19,1	33.405	15,0	35.308	15,7	23.403	12,5	25.653	14,8	25.653	14,8
Ipi.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*
IREN.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	300	0,2	300	0,2	800	0,5
Irfis - Mediocredito della Sicilia 3).....	52	0,1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Isaia & Isaia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Istituto di Credito Sportivo.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	170	0,1	170	0,1	170	0,1	170	0,1	—	—
IVS Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	200	0,1	254	0,1	254	0,1	254	0,1
Landi Renzo.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	34	*	
LEGO - Legatoria Editoriale Giovanni Olivotto.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	7	*	
L'Isolante K-Flex.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	100	0,1	100	0,1	100	0,1
Ligabue.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	
Luxottica.....	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,5	500	0,3	1.000	0,4	1.000	0,4	1.500	0,8	1.000	0,6	1.000	0,6
Mantovabanca 1896 CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	40	*	40	*	40	*	40	*	—	—
Manutencoop Facility Management.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	425	0,2	425	0,2	425	0,2	425	0,2
Marcolin.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	200	0,1	200	0,1	200	0,1	200	0,1
MCC - Mediocredito Centrale.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	498	0,2	463	0,2	463	0,2	463	0,2
Mediobanca.....	4.489	6,9	4.994	8,4	5.205	10,9	10.851	15,1	11.945	12,1	11.936	7,0	12.955	5,8	13.200	5,9	11.736	6,3	7.286	4,2	7.286	4,2
Mediocredito del Friuli Venezia Giulia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	195	0,1	195	0,1	195	0,1	195	0,1	65	*
Mediocredito Trentino Alto Adige.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	185	0,1	185	0,1	60	*	—	—	—	—
MEP.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	—	—	—	—
Mercedes-Benz Financial Services Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	150	0,1	
Meridie.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*	4	*	4	*	—	—
Micoperi.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	35	*	
Mille Uno..... 5)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*	9	*	9	*	7	*
Mittel.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	100	*	100	0,1	100	0,1	100	0,1
Molinari.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*
NoemaLife.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	
Officine Maccaferri.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	198	0,1	198	0,1	198	0,1
Olsa.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	10	*
Oxon Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*	
Pasta Zara.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	
Pirelli & C.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,3	500	0,2	500	0,2	500	0,3	500	0,3	500	0,3
Poste Italiane.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,3	750	0,4	750	0,4	750	0,4
Prismian.....	—	—	—	—	—	—	—	—	400	0,4	400	0,2	400	0,2	400	0,2	400	0,2	400	0,2	750	0,4
Proma.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	
QS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	
Rai - Radiotelevisione Italiana.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	350	0,2	
Renco Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	
Rhino Bondco.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	413	0,2	462	0,2	463	0,3	463	0,3
Rigoni di Asiago.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*	7	*

1) Gruppo GE Commercial Finance. - 2) Già Banco Ambrosiano Veneto, poi Banca Intesa, dopo IntesaBci, quindi Banca Intesa. - 3) Gli importi indicati includono quelli relativi al Sanpaolo IMI, incorporato nel 2007 e quelli relativi al Banco di Napoli, incorporato da Sanpaolo IMI nell'1-2003 (1.990 nel 2006). - 4) Gruppo Poste Italiane. - 5) Già Milleuno Bingo.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Romagna Est BCC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Rovigobanca CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sace BT.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Salini Impregilo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sara Assicurazioni.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SCCI - Società di Cartolarizzazione dei Crediti INPS.....	10.050	15,3	8.550	14,3	5.125	10,7	3.075	4,3
SCIC - Società di Cartolarizzazione Italiana Crediti.....	1.502	2,3	1.277	2,1	760	1,6	197	0,3
Selle Royal.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Settentrionale Trasporti.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SGG Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SIAS.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SIGIT - Società Italiana Gomma Industriale Torino.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SIPCAM - Società Italiana Prodotti Chimici e per l'Agricoltura Milano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sisal Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Snam.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sudcommerci.....	—	—	—	—	—	—	—	—
TBS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Teamsystem Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Tecnocap.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Telecom Italia.....	2.000	3,1	2.000	3,3	2.000	4,2	3.250	4,5
Tercas - Cassa di Risparmio della Provincia di Teramo..	—	—	—	—	—	—	—	—
Terna.....	—	—	—	—	—	—	—	—
TermeEnergia.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Terre Cortesi Moncaro Sca.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Tesmec.....	—	—	—	—	—	—	—	—
TIP.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Trevi Finanziaria Industriale.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Twin Set - Simona Barbieri.....	—	—	—	—	—	—	—	—
UBI Banca..... ¹⁾	1.362	2,1	1.232	2,1	961	2,0	3.150	4,4
UGF.....	—	—	—	—	—	—	750	1,0
UniCredit..... ²⁾³⁾	14.681	22,5	12.895	21,4	9.968	20,8	12.020	16,7
Veneto Banca.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Vibanca - BCC di S. Pietro in Vincio.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Waste Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Totale.....	65.320	100,0	59.797	100,0	47.955	100,0	72.099	100,0
<i>% sul totale generale.....</i>		<i>2,9</i>		<i>2,5</i>		<i>1,8</i>		<i>2,3</i>
<i>di cui:</i>								
<i>Assicurative e bancarie.....</i>	<i>50.767</i>	<i>77,7</i>	<i>44.670</i>	<i>74,7</i>	<i>36.770</i>	<i>76,7</i>	<i>51.378</i>	<i>71,3</i>
<i>Industriali.....</i>	<i>14.552</i>	<i>22,3</i>	<i>15.127</i>	<i>25,3</i>	<i>11.185</i>	<i>23,3</i>	<i>20.722</i>	<i>28,7</i>
DI ENTI INTERNAZIONALI								
BEI - Banca Europea per gli Investimenti.....	6.006	76,8	32.596	96,1	55.226	97,6	66.500	98,3
BERS - Banca Europea per la Ricostruzione e lo Sviluppo	601	7,7	601	1,8	601	1,1	601	0,9

31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015			
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%		
—	—	—	—	50	*	50	*	50	*	—	—		
—	—	—	—	26	*	26	*	—	—	—	—		
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*		
—	—	—	—	—	—	—	—	400	0,2	400	0,2		
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*		
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—		
—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*		
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*		
—	—	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*		
500	0,5	500	0,3	500	0,2	500	0,2	500	0,3	500	0,3		
—	—	—	—	—	—	—	—	6	*	6	*		
—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*		
—	—	—	—	—	—	—	271	0,1	271	0,1	271	0,2	
—	—	—	—	—	—	6.000	2,7	7.500	3,3	9.100	4,9	9.100	5,3
—	—	—	—	—	—	—	—	22	*	22	*	22	*
—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*
—	—	—	—	—	—	—	—	300	0,1	557	0,3	558	0,3
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*
5.000	5,1	7.750	4,6	9.000	4,0	10.907	4,9	12.020	6,4	12.270	7,1	—	—
—	—	40	*	340	0,2	300	0,1	—	—	—	—	—	—
—	—	1.250	0,7	2.500	1,1	2.500	1,1	2.500	1,3	3.500	2,0	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	25	*	25	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	100	0,1	100	0,1	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	50	*	50	*	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	150	0,1	150	0,1	—	—
5.970	6,0	9.615	5,6	15.107	6,8	13.072	5,8	5.893	3,2	4.710	2,7	—	—
750	0,8	750	0,4	1.350	0,6	1.350	0,6	1.850	1,0	2.450	1,4	—	—
12.224	12,3	20.134	11,8	34.591	15,5	30.257	13,5	18.640	10,0	16.980	9,8	—	—
—	—	1.500	0,9	1.500	0,7	1.700	0,8	2.550	1,4	1.450	0,8	—	—
—	—	—	—	16	*	16	*	16	*	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	200	0,1	200	0,1	—	—
98.989	100,0	170.292	100,0	222.971	100,0	224.285	100,0	186.961	100,0	172.883	100,0	—	—
	<i>2,9</i>		<i>4,6</i>		<i>5,8</i>		<i>5,4</i>		<i>3,8</i>		<i>3,4</i>		
<i>68.927</i>	<i>69,6</i>	<i>131.718</i>	<i>77,3</i>	<i>167.674</i>	<i>75,2</i>	<i>158.230</i>	<i>70,5</i>	<i>107.894</i>	<i>57,7</i>	<i>86.629</i>	<i>50,1</i>	<i>—</i>	<i>—</i>
<i>30.062</i>	<i>30,4</i>	<i>38.575</i>	<i>22,7</i>	<i>55.298</i>	<i>24,8</i>	<i>66.055</i>	<i>29,5</i>	<i>79.067</i>	<i>42,3</i>	<i>86.254</i>	<i>49,9</i>	<i>—</i>	<i>—</i>
66.114	98,3	83.434	63,7	94.350	43,1	104.887	41,4	104.576	34,7	100.826	31,7	—	—
601	0,9	551	0,4	339	0,2	339	0,1	339	0,1	339	0,1	—	—

1) Gli importi indicati includono quelli relativi a Centrobanca (incorporata nel I-2013) (802 nel 2006, 782 nel 2007, 711 nel 2008, 692 nel 2009, 641 nel 2010, 617 nel 2001, 607 nel 2012 e 553 nel 2013). Nel IV-2007 ha incorporato Banca Lombarda. - 2) Gli importi indicati

includono quelli relativi a FinecoGroup (incorporata in Capitalia nel XII-2005) e a Capitalia (incorporata nel I-2008) (4.277 nel 2006). - 3) Già Unicredito Italiano.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO

LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI

AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
BIRS - Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo..... ¹⁾	741	9,5	225	0,7	220	0,4	75	0,1
CEDB - Council of Europe Development Bank.....	265	3,4	265	0,8	265	0,5	265	0,4
EFSF - European Financial Stability Facility.....	—	—	—	—	—	—	—	—
ESM - European Stability Mechanism.....	—	—	—	—	—	—	—	—
EU - European Union.....	—	—	—	—	—	—	—	—
IDB - Inter-American Development Bank.....	207	2,6	207	0,6	207	0,4	207	0,3
<i>Totale</i>	<i>7.820</i>	<i>100,0</i>	<i>33.894</i>	<i>100,0</i>	<i>56.519</i>	<i>100,0</i>	<i>67.647</i>	<i>100,0</i>
<i>% sul totale generale</i>		<i>0,4</i>		<i>1,4</i>		<i>2,1</i>		<i>2,2</i>
DI SOCIETÀ ESTERE								
Abbey National Financial Services.....	—	—	—	—	—	—	—	—
ABN Amro Bank..... ²⁾	—	—	1.487	9,7	1.477	8,5	4.469	4,3
Accor.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Achmea Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Adecco International Financial Services.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Adidas.....	—	—	—	—	—	—	500	0,5
Air Liquide Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Air France-KLM.....	—	—	—	—	—	—	700	0,7
Airbus Group Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Allied Irish Banks.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Alstom.....	—	—	—	—	—	—	—	—
American Honda Finance.....	—	—	—	—	—	—	750	0,7
Anheuser-Busch Inbev.....	—	—	—	—	—	—	—	—
ArcelorMittal.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Areva.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Astrazeneca.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of America Corporation.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of Ireland.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Banque PSA Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Barclays Bank..... ³⁾	—	—	—	—	229	1,3	989	1,0
BAT International Finance.....	—	—	—	—	—	—	650	0,6
Bayer..... ⁴⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Bayerische Hypo-und Vereinsbank.....	3.474	30,7	3.255	21,2	1.204	6,9	—	—
BBVA - Banco Bilbao Vizcaya Argentaria..... ⁵⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Bertelsmann SE & Co. KgaA.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BFCM - Banque Fédérative du Crédit Mutuel.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BMW Finance..... ⁶⁾	—	—	—	—	—	—	3.000	2,9
BNP Paribas.....	—	—	—	—	—	—	51	*
BP Capital Markets.....	—	—	—	—	—	—	—	—
British American Tobacco Holdings.....	—	—	—	—	—	—	—	—
British Sky Broadcasting Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Carlsberg Breweries.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Carrefour.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Casino Guichard Perrachon.....	—	—	—	—	—	—	—	—

31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
75	0,1	75	0,1	75	*	75	*	75	*	75	*
265	0,4	265	0,2	265	0,1	265	0,1	1.265	0,4	1.265	0,4
—	—	16.000	12,2	88.200	40,3	111.900	44,2	125.400	41,7	129.150	40,6
—	—	—	—	—	—	—	—	23.988	8,0	45.488	14,3
—	—	30.350	23,2	35.650	16,3	35.650	14,1	45.110	15,0	40.710	12,8
207	0,3	207	0,2	207	0,1	207	0,1	207	0,1	207	0,1
<i>67.262</i>	<i>100,0</i>	<i>130.882</i>	<i>100,0</i>	<i>219.085</i>	<i>100,0</i>	<i>253.322</i>	<i>100,0</i>	<i>300.958</i>	<i>100,0</i>	<i>318.059</i>	<i>100,0</i>
	<i>2,0</i>		<i>3,5</i>		<i>5,7</i>		<i>6,1</i>		<i>6,2</i>		<i>6,2</i>
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	3.500	0,8
5.834	2,9	4.577	1,8	4.111	1,5	4.111	1,4	1.384	0,4	2.957	0,6
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.150	0,2
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
500	0,3	500	0,2	500	0,2	500	0,2	1.000	0,3	1.000	0,2
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
700	0,4	700	0,3	700	0,3	700	0,2	1.300	0,4	1.300	0,3
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2
750	0,4	750	0,3	750	0,3	750	0,3	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,3	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	600	0,2	3.000	0,6
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2	750	0,2
2.000	1,0	2.154	0,8	2.141	0,8	2.139	0,7	5.888	1,8	8.626	1,8
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2
2.600	1,3	4.350	1,7	4.950	1,8	4.800	1,7	3.000	0,9	1.000	0,2
6.745	3,4	6.285	2,4	5.329	2,0	2.855	1,0	5.321	1,7	3.280	0,7
650	0,3	650	0,3	650	0,2	650	0,2	650	0,2	4.250	0,9
1.300	0,7	1.300	0,5	1.300	0,5	1.300	0,5	2.000	0,6	2.000	0,4
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
2.250	1,1	3.250	1,3	2.250	0,8	3.750	1,3	2.750	0,9	1.500	0,3
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4.000	0,9
6.750	3,4	11.150	4,3	8.900	3,3	8.900	3,1	9.000	2,8	15.750	3,4
1.551	0,8	3.500	1,4	4.750	1,8	4.750	1,7	4.750	1,5	6.250	1,3
2.000	1,0	2.000	0,8	2.000	0,7	2.600	0,9	5.600	1,7	8.100	1,7
—	—	600	0,2	600	0,2	600	0,2	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	2.000	0,6	2.000	0,4
1.000	0,5	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,4	2.000	0,6	2.000	0,4
—	—	—	—	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,3	1.000	0,2
—	—	—	—	—	—	—	—	2.450	0,8	2.450	0,5

1) Appartenente al World Bank Group. - 2) Gli importi indicati includono quelli relativi ad ABN Amro Bank (1.487 nel 2007, 1.477 nel 2008, 3.744 nel 2009, 4.104 nel 2010, 2.847 nel 2011, 2.581 nel 2012 e nel 2013, 722 nel 2014 e 2.431 nel 2015) ed ABN Amro Holding (725 nel 2009, 1.730 nel 2010 e nel 2011, 1.530 nel 2012 e nel 2013, 661 nel 2014 e 526 nel 2015). - 3) Gli importi indicati includono quelli relativi a Barclays Bank (229 nel 2008, 989 nel 2009, 5.845 nel 2010, 5.465 nel 2011, 4.946 nel 2012, 2.512 nel 2013, 3.987 nel 2014 e 2.273 nel 2015) e Barclays (900 nel 2010, 820 nel 2011, 383 nel 2012, 343 nel 2013, 1.334 nel 2014 e 1.000 nel 2015). - 4) Gli importi

indicati includono quelli relativi a Bayer Capital Corporation (1.300 nel 2013) e Bayer (2.000 nel 2014). - 5) Gli importi indicati includono quelli relativi a BBVA Senior Finance (1.000 nel 2010, 2.000 nel 2011, 1.000 nel 2012, 2.500 nel 2013 e 1.500 nel 2014 e nel 2015) e BBVA (1.250 nel 2010, nel 2011, nel 2012, nel 2013 e nel 2014). - 6) Gli importi indicati includono quelli relativi a BMW Finance (2.250 nel 2009, 6.000 nel 2010, 10.400 nel 2011, 8.150 nel 2012, 8.900 nel 2013, 9.000 nel 2014 e 12.750 nel 2015) e BMW US Capital (750 nel 2009, nel 2010, nel 2011 e nel 2012 e 3.000 nel 2015).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Cellnex Telecom.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Ceske Energeticke Zavody.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Citigroup ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Compagnie de Saint-Gobain.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Conti-Gummi Finance..... ²⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Continental.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Continental Rubber of America.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Crédit Agricole..... ³⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Credit Suisse..... ⁴⁾	—	—	—	—	—	—	900	0,9
DaimlerChrysler..... ⁵⁾	—	—	—	—	—	—	4.000	3,9
Danone Groupe.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Danske Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Bahn Finance.....	2.350	20,7	2.350	15,3	2.350	13,6	1.000	1,0
Deutsche Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Boerse.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Lufthansa.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Post.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Postbank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Telekom International Finance.....	—	—	—	—	—	—	6.500	6,3
Diageo Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Dresdner Bank..... ⁶⁾	239	2,1	462	3,0	462	2,7	200	0,2
DS Smith.....	—	—	—	—	—	—	—	—
DVB Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
EDF - Electricité de France.....	—	—	—	—	—	—	—	—
EDP Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
EnBW International Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
ENEL Finance International..... ⁷⁾	—	—	—	—	—	—	4.300	4,2
Engie..... ^{8) 9)}	—	—	—	—	—	—	650	0,6
Eurogrid.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Eutelsat.....	—	—	—	—	—	—	—	—
FCA Capital Ireland..... ¹⁰⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
FCE Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Fiat Chrysler Finance Europe..... ¹¹⁾	2.917	25,8	2.794	18,2	2.670	15,4	6.547	6,3
Fimmeccanica Finance.....	—	—	—	—	—	—	1.800	1,7
General Electric Capital Corporation..... ¹²⁾	—	—	—	—	—	—	13.750	13,3
GIE PSA Trésorerie.....	—	—	—	—	—	—	600	0,6
GlaxoSmithKline Capital.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Glencore Finance Europe.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs Group..... ¹³⁾	604	5,3	1.432	9,3	1.432	8,3	1.432	1,4
Heineken.....	—	—	—	—	—	—	—	—
HSBC Bank..... ¹⁴⁾	—	—	—	—	—	—	1.250	1,2
Iberdrola..... ¹⁵⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
IBM - International Business Machine Corporation.....	—	—	—	—	—	—	1.000	1,0
Infineon Technologies.....	—	—	—	—	—	—	—	—
ING Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Instituto de Credito Oficial.....	—	—	—	—	—	—	200	0,2
Intesa Sanpaolo Bank Ireland.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Italcementi Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
IVS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Cellnex Telecom.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	600	0,1
Ceske Energeticke Zavody.....	750	0,4	750	0,3	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2
Citigroup ¹⁾	1.348	0,7	3.855	1,5	3.823	1,4	3.815	1,3	8.065	2,5	6.781	1,5
Compagnie de Saint-Gobain.....	750	0,4	2.500	1,0	2.500	0,9	2.500	0,9	2.500	0,8	1.500	0,3
Conti-Gummi Finance..... ²⁾	—	—	—	—	—	—	750	0,3	750	0,2	750	0,2
Continental.....	—	—	—	—	—	—	750	0,3	750	0,2	750	0,2
Continental Rubber of America.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
Crédit Agricole..... ³⁾	274	0,1	274	0,1	274	0,1	274	0,1	1.774	0,6	5.274	1,1
Credit Suisse..... ⁴⁾	3.175	1,6	3.175	1,2	2.882	1,1	2.755	1,0	10.223	3,2	16.250	3,5
DaimlerChrysler..... ⁵⁾	7.700	3,9	6.700	2,6	6.750	2,5	8.000	2,8	5.750	1,8	7.500	1,6
Danone Groupe.....	—	—	500	0,2	500	0,2	500	0,2	500	0,2	2.000	0,4
Danske Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2
Deutsche Bahn Finance.....	500	0,3	1.000	0,4	1.000	0,4	1.500	0,5	1.500	0,5	2.150	0,5
Deutsche Bank.....	1.043	0,5	1.043	0,4	1.043	0,4	1.043	0,4	—	—	—	—
Deutsche Boerse.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
Deutsche Lufthansa.....	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1
Deutsche Post.....	—	—	—	—	—	—	1.000	0,4	1.000	0,3	1.000	0,2
Deutsche Postbank.....	—	—	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,3	1.000	0,2
Deutsche Telekom International Finance.....	8.250	4,2	5.750	2,2	5.750	2,1	7.750	2,7	7.000	2,2	7.750	1,7
Diageo Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—	850	0,3	850	0,2
Dresdner Bank..... ⁶⁾	200	0,1	200	0,1	200	0,1	—	—	—	—	—	—
DS Smith.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
DVB Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.500	0,3
EDF - Electricité de France.....	—	—	2.500	1,0	2.500	0,9	3.900	1,4	3.900	1,2	3.900	0,8
EDP Finance.....	—	—	750	0,3	750	0,3	1.350	0,5	2.350	0,7	2.350	0,5
EnBW International Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
ENEL Finance International..... ⁷⁾	4.300	2,2	8.300	3,2	11.300	4,2	11.300	4,0	11.300	3,5	11.513	2,5
Engie..... ^{8) 9)}	2.000	1,0	2.000	0,8	2.000	0,7	2.000	0,7	4.500	1,4	7.000	1,5
Eurogrid.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2
Eutelsat.....	850	0,4	850	0,3	850	0,3	850	0,3	850	0,3	850	0,2
FCA Capital Ireland..... ¹⁰⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2	2.250	0,5
FCE Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.950	0,4
Fiat Chrysler Finance Europe..... ¹¹⁾	5.423	2,7	9.700	3,8	9.900	3,7	12.000	4,2	13.400	4,2	10.900	2,3
Fimmeccanica Finance.....	2.300	1,2	2.300	0,9	2.900	1,1	2.600	0,9	2.600	0,8	2.600	0,6
General Electric Capital Corporation..... ¹²⁾	16.750	8,4	18.650	7,3	16.750	6,3	18.000	6,3	12.900	4,0	16.850	3,6
GIE PSA Trésorerie.....	600	0,3	600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,1
GlaxoSmithKline Capital.....	—	—	—	—	—	—	—	—	2.500	0,8	2.500	0,5
Glencore Finance Europe.....	—	—	—	—	—	—	750	0,3	1.450	0,4	4.550	1,0
Goldman Sachs Group..... ¹³⁾	883	0,4	2.080	0,8	2.080	0,8	1.306	0,5	3.556	1,1	11.400	2,4
Heineken.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
HSBC Bank..... ¹⁴⁾	2.750	1,4	2.750	1,1	2.750	1,0	2.750	1,0	3.750	1,2	5.250	1,1
Iberdrola..... ¹⁵⁾	1.250	0,6	2.750	1,1	2.750	1,0	2.750	1,0	2.500	0,8	3.600	0,8
IBM - International Business Machine Corporation.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Infineon Technologies.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
ING Bank.....	1.250	0,6	1.250	0,5	1.250	0,5	1.250	0,4	1.250	0,4	1.500	0,3
Instituto de Credito Oficial.....	200	0,1	200	0,1	200	0,1	200	0,1	300	0,1	—	—
Intesa Sanpaolo Bank Ireland.....	—	—	—	—	1.500	0,6	—	—	—	—	—	—
Italcementi Finance.....	750	0,4	750	0,3	750	0,3	1.100	0,4	1.100	0,3	1.100	0,2
IVS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	240	0,1

1) Gli importi indicati includono quelli relativi a Citigroup Funding (980 nel 2010, 105 nel 2011, 73 nel 2012, 65 nel 2013 e 2014 e 31 nel 2015) e Citigroup (1.250 nel 2010, 3.750 nel 2011, nel 2012e nel 201, 8.000 nel 2014 e 6.750 nel 2015). - 2) Gruppo Continental. - 3) Gli importi indicati includono quelli relativi a Crédit Agricole (274 nel 2013 e nel 2014 e 2.274 nel 2015) e Crédit Agricole Filiale del Regno Unito (1.500 nel 2014 e 3.000 nel 2015). - 4) Gli importi indicati includono quelli relativi a Credit Suisse (900 nel 2009, 917 nel 2010 e nel 2011, 628 nel 2012, 501 nel 2013, 473 nel 2014 e 3.500 nel 2015) e Credit Suisse Filiale del Regno Unito (2.258 nel 2010 e nel 2011, 2.254 nel 2012 e nel 2013, 9.750 nel 2014 e 12.750 nel 2015). - 5) Gli importi indicati includono quelli relativi a Daimler International Finance (2.000 nel 2009, 3.700 nel 2010, 2.700 nel 2011, 2.000 nel 2012, 2.000 nel 2013) e DaimlerChrysler (2.000 nel 2009, 4.000 nel 2010 e 2011, 4.750 nel 2012, 6.000 nel 2013, 5.750 nel 2014 e 7.500 nel 2015). - 6) Gruppo Commerzbank. - 7) Gli importi indicati includono quelli relativi ad Enel Finance International (4.000 nel 2009, nel 2010, 8.000 nel 2011 e 11.000 nel 2012, nel 2013 e nel 2014 e 11.213 nel 2015) ed Enel Investment Holding (300 nel 2009, nel 2010, nel 2011, nel 2012, nel 2013, nel 2014 e nel 2015). - 8) Già GDF Suez. - 9) Gli importi indicati includono quelli relativi a Groupement d'intérêt économique Suez Alliance (650 nel 2009) e GDF Suez (1.000 nel 2010). - 10) Già FGA Capital Ireland. - 11) Gli importi indicati includono quelli relativi a Fiat Chrysler Finance Europe, già Fiat Finance and

Trade (2.917 nel 2006, 2.794 nel 2007, 2.670 nel 2008, 6.547 nel 2009, 5.423 nel 2010, 6.500 nel 2011, 6.700 nel 2012, 8.800 nel 2013, 8.500 e nel 2014 e 7.000 nel 2015). CNH Industrial Finance Europe, già Fiat Industrial Finance Europe (2.200 nel 2011, nel 2012 e nel 2013, 3.900 nel 2014 e 2.900 nel 2015) e Fiat Chrysler Finance North America, già Fiat Finance North America (1.000 nel 2011, nel 2012, nel 2013, nel 2014 e nel 2015). - 12) Gli importi indicati includono quelli relativi a General Electric Capital Corporation (2.000 nel 2009), GE Capital European Funding (10.000 nel 2009, 14.750 nel 2010, 16.650 nel 2011, 14.750 nel 2012, 16.000 nel 2013, 12.900 nel 2014 e 16.850 nel 2015) e GE Capital UK Funding (2.000 nel 2009, nel 2010, nel 2011, nel 2012 e nel 2013). - 13) Gli importi indicati includono quelli relativi a Goldman Sachs Group (604 nel 2006, 1.432 nel 2007, 2008 e 2009, 883 nel 2010, 2.080 nel 2011 e 2012, 1.306 nel 2013, 3.556 nel 2014 e 10.350 nel 2015), Goldman Sachs International (50 nel 2015) e Goldman Sachs & Co. (1.000 nel 2015). - 14) Gli importi indicati includono quelli relativi a HSBC Bank (1.250 nel 2009, 2.750 nel 2010, nel 2011, nel 2012 e nel 2013 e 3.750 nel 2014 e nel 2015) e HSBC Holdings (1.500 nel 2015). - 15) Gli importi indicati includono quelli relativi a Iberdrola Finanzas (1.250 nel 2010, 2.750 nel 2011, 2012 e 2013 e 2.000 nel 2014 e nel 2015) e Iberdrola International (500 nel 2014 e 1.600 nel 2015).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO

LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI

AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Jefferies Group Inc	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1
JP Morgan Chase & Co.	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4.000	1,2	9.000	1,9
K & S	—	—	—	—	—	—	750	0,7	750	0,4	750	0,3	750	0,3	750	0,3	—	—	—	—
KBC Ifima	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,3	1.000	0,2	
Kering	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	1.000	0,2	
KFW - Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	50	0,4	50	0,3	50	0,3	50	*	8.050	4,1	18.050	7,0	23.050	8,6	23.050	8,1	20.050	6,2	18.050	3,9
Koninklijke DSM	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2
Koninklijke KPN	—	—	—	—	—	—	2.425	2,3	3.425	1,7	2.000	0,8	2.000	0,7	2.000	0,7	2.000	0,6	1.000	0,2
Lafarge	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,5	1.000	0,4	1.000	0,4	1.750	0,6	1.750	0,5	1.750	0,4
Leeds Building Society	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
Lehman Brothers Treasury	15	0,1	113	0,7	113	0,7	113	0,1	13	*	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Lloyds Bank	—	—	—	—	—	—	5.000	4,8	6.500	3,3	6.500	2,5	6.500	2,4	7.500	2,6	10.000	3,1	14.000	3,0
LVMH - Louis Vuitton Moet Hennessy	—	—	—	—	—	—	600	0,6	600	0,3	—	—	—	—	600	0,2	1.250	0,4	1.250	0,3
Macquarie Structured Securities (Europe)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	95	*	95	*	95	*	95	*	95	*
Man	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2
McDonald's Corporation	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	350	0,1	850	0,3	2.250	0,5
Merck Financial Services	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.050	0,4
Merrill Lynch	837	7,4	1.901	12,4	3.312	19,1	4.883	4,7	4.832	2,4	6.120	2,4	5.371	2,0	2.225	0,8	25	*	25	*
Metro	—	—	—	—	—	—	600	0,6	1.350	0,7	1.350	0,5	1.850	0,7	1.850	0,6	1.750	0,5	2.350	0,5
Morgan Stanley	841	7,4	1.530	10,0	4.025	23,2	3.923	3,8	5.243	2,6	4.818	1,9	3.628	1,4	1.513	0,5	1.513	0,5	1.513	0,3
National Australia Bank	—	—	—	—	—	—	—	—	1.250	0,6	1.250	0,5	1.250	0,5	1.250	0,4	1.250	0,4	2.250	0,5
Nationwide Building Society	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2
Nestlé Finance International	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,2	1.000	0,2	
Nomura Europe Finance	—	—	—	—	—	—	1.000	1,0	1.000	0,5	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,4	—	—	—	—
Nordea Bank	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.250	0,8	2.250	0,8	2.250	0,7	3.000	0,6
NV Bank Nederlandse Gemeenten	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	3.400	0,7
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1
Orange	—	—	—	—	—	—	2.150	2,1	2.250	1,1	5.480	2,1	4.730	1,8	6.230	2,2	6.230	1,9	5.080	1,1
OTE	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.250	0,5	1.250	0,5	—	—	—	—	—	—
Pernod Ricard	—	—	—	—	—	—	—	—	1.200	0,6	1.200	0,5	1.200	0,4	1.200	0,4	1.850	0,6	2.350	0,5
Peugeot	—	—	—	—	—	—	750	0,7	1.750	0,9	2.250	0,9	2.850	1,1	4.450	1,6	3.700	1,1	3.200	0,7
Pohjola Bank	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2	
Portugal Telecom International Finance	—	—	—	—	—	—	750	0,7	750	0,4	750	0,3	750	0,3	750	0,3	750	0,2	2.132	0,5
Rabobank Nederland	—	—	—	—	—	—	—	—	12.500	6,3	16.000	6,2	16.000	6,0	16.000	5,6	9.500	2,9	9.000	1,9
Renault	—	—	—	—	—	—	2.000	1,9	4.775	2,4	5.375	2,1	5.525	2,1	4.950	1,7	6.400	2,0	8.150	1,7
Repsol International Finance	—	—	—	—	—	—	1.000	1,0	1.000	0,5	3.636	1,4	2.886	1,1	2.886	1,0	1.886	0,6	2.486	0,5
Rheinmetall	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,3	500	0,2	500	0,2	500	0,2	500	0,2	500	0,1
Roche Finance Europe	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2
Royal Bank of Canada	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.250	0,3
RTE - Réseau de transport d'électricité	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	1.500	0,3
RWE Finance	—	—	—	—	—	—	1.500	1,4	1.500	0,8	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2
Ryanair	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	850	0,3	1.700	0,4
Sanofi Aventis	—	—	—	—	—	—	1.500	1,4	1.500	0,8	1.500	0,6	1.500	0,6	3.500	1,2	5.050	1,6	5.050	1,1
Santander 47)	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,5	1.000	0,4	1.000	0,4	—	—	—	—	5.500	1,2
SAP	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,5	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,4	500	0,2	2.100	0,5
Schneider Electric	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.550	0,3
SFEF - Société de financement de l'économie française ..	—	—	—	—	—	—	5.000	4,8	5.000	2,5	5.000	1,9	5.000	1,9	5.000	1,8	—	—	—	—
Shell International Finance	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.500	1,0	2.500	0,9	2.500	0,9	4.750	1,5	8.200	1,8
Siemens Financieringsmaatschappij	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.250	0,3

1) Già Lloyds TSB Bank. - 2) Gruppo Bank of America. - 3) Già France Télécom. - 4) Gli importi indicati includono quelli relativi a RCI Banque - Renault Credit International (500 nel 2009, 2.875 nel 2010, 2.975 nel 2011, 3.125 nel 2012, 1.950 nel 2013, 3.650 nel 2014 e 6.050 nel 2015) e Renault (1.500 nel 2009, 1.900 nel 2010, 2.400 nel 2011 e nel 2012, 3.000 nel 2013, 2.750 nel 2014 e 2.100 nel 2015). -

5) Gli importi indicati includono quelli relativi a Santander International Debt (1.000 nel 2010, nel 2011 e nel 2012, 1.250 nel 2015), Santander Consumer Bank (750 nel 2015), Santander Consumer Finance (2.000 nel 2015) e Santander Issuances (1.500 nel 2015).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2006		31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Skandinaviska Enskilda Banken	—	—	—	—	—	—	—	—
Société Générale..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Sodexo	—	—	—	—	—	—	—	—
Statkraft	—	—	—	—	—	—	—	—
Statoil Asa.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Suez Environment Company.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Swedbank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Telecom Italia Finance	—	—	—	—	—	—	1.865	1,8
Telefonica Emisiones	—	—	—	—	—	—	3.750	3,6
Telekom Finanzmanagement.....	—	—	—	—	—	—	1.250	1,2
Teliasonera	—	—	—	—	—	—	—	—
Tesco	—	—	—	—	—	—	750	0,7
Teva Pharmaceutical Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Thales	—	—	—	—	—	—	—	—
The Royal Bank of Scotland..... ²⁾	—	—	—	—	—	—	2.000	1,9
Thyssenkrupp.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Total Capital..... ³⁾	—	—	—	—	—	—	550	0,5
Toyota Motor Credit Corporation.....	—	—	—	—	—	—	—	—
UBS..... ⁴⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Unilever	—	—	—	—	—	—	—	—
Urenco Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Veolia Environment	—	—	—	—	—	—	900	0,9
Verbund International Finance.....	—	—	—	—	—	—	840	0,8
Vivendi.....	—	—	—	—	—	—	1.200	1,2
Vodafone Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Volkswagen Bank	—	—	—	—	—	—	1.250	1,2
Wells Fargo & Company..... ⁶⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Wurth Finance International.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Totale	11.327	100,0	15.373	100,0	17.323	100,0	103.587	100,0
<i>% sul totale generale</i>		<i>0,5</i>		<i>0,6</i>		<i>0,6</i>		<i>3,3</i>
<i>di cui:</i>								
<i>Assicurative e bancarie</i>	<i>6.060</i>	<i>53,5</i>	<i>10.230</i>	<i>66,5</i>	<i>12.303</i>	<i>71,0</i>	<i>28.310</i>	<i>27,3</i>
<i>Industriali</i>	<i>5.267</i>	<i>46,5</i>	<i>5.144</i>	<i>33,5</i>	<i>5.020</i>	<i>29,0</i>	<i>75.277</i>	<i>72,7</i>
Totale generale	2.222.044	100,0	2.420.226	100,0	2.684.279	100,0	3.142.087	100,0

TITOLI	31-XII-2010		31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	600	0,1
246	0,1	2.557	1,0	2.557	1,0	557	0,2	526	0,2	2.801	0,6	
—	—	—	—	—	—	—	—	1.100	0,3	1.100	0,2	
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.250	0,5	
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.000	0,4	
1.865	0,9	1.865	0,7	1.865	0,7	1.015	0,4	1.015	0,3	1.015	0,2	
5.150	2,6	6.350	2,5	8.550	3,2	18.102	6,3	16.652	5,2	16.252	3,5	
1.250	0,6	1.250	0,5	1.250	0,5	500	0,2	500	0,2	1.250	0,3	
500	0,3	1.750	0,7	1.750	0,7	1.750	0,6	1.750	0,5	1.750	0,4	
—	—	—	—	—	—	—	—	2.000	0,6	2.000	0,4	
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.000	0,4	
600	0,3	600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,1	
8.778	4,4	10.461	4,1	10.486	3,9	10.493	3,7	9.402	2,9	7.990	1,7	
—	—	—	—	1.250	0,5	1.250	0,4	2.500	0,8	3.850	0,8	
1.050	0,5	1.050	0,4	1.050	0,4	1.050	0,4	3.550	1,1	3.850	0,8	
2.500	1,3	2.500	1,0	—	—	—	—	1.000	0,3	4.250	0,9	
100	0,1	160	0,1	130	*	130	*	3.130	1,0	8.380	1,8	
—	—	750	0,3	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2	
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1	
900	0,5	900	0,4	900	0,3	900	0,3	900	0,3	1.400	0,3	
840	0,4	840	0,3	840	0,3	840	0,3	840	0,3	840	0,2	
1.950	1,0	1.950	0,8	1.950	0,7	2.700	0,9	2.700	0,8	2.700	0,6	
1.250	0,6	1.250	0,5	1.250	0,5	1.250	0,4	2.250	0,7	3.500	0,8	
4.750	2,4	7.000	2,7	8.550	3,2	8.500	3,0	9.700	3,0	19.300	4,1	
—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,3	5.000	1,1	
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	
198.392	100,0	256.550	100,0	267.895	100,0	285.284	100,0	322.274	100,0	466.580	100,0	
	<i>5,8</i>		<i>6,9</i>		<i>6,9</i>		<i>6,9</i>		<i>6,4</i>		<i>8,9</i>	
86.964	43,8	115.459	45,0	123.654	46,2	112.616	39,5	127.206	39,5	196.577	42,1	
111.428	56,2	141.091	55,0	144.241	53,8	172.668	60,5	195.068	60,5	270.003	57,9	
3.418.771	99,9	3.693.760	99,9	3.868.702	100,1	4.156.873	99,9	4.864.385	100,0	5.135.642	100,0	

1) Gli importi indicati includono quelli relativi a SGA - Société Générale Acceptance (21 nel 2010, nel 2011, nel 2012 e nel 2013), Société Générale (225 nel 2010 e 2.536 nel 2011 e nel 2012, 536 nel 2013, 526 nel 2014 e 2.801 nel 2015). - 2) Gli importi indicati includono quelli relativi a The Royal Bank of Scotland Group (2000 nel 2009, nel 2010 e nel 2011, 2.008 nel 2012 e nel 2013 e 3.000 nel 2014 e nel 2015), The Royal Bank of Scotland NV (2.528 nel 2010, 3.838 nel 2011, 3.856 nel 2012, 3.841 nel 2013, 2.019 nel 2014 e 1.879 nel 2015) e The Royal Bank of Scotland PLC (4.250 nel 2010, 4.623 nel 2011 e nel 2012, 4.645 nel 2013, 4.383 nel 2014 e 3.111 nel 2015). - 3) Gli importi indicati includono quelli relativi ad Total Capital (550 nel 2009, 1.050 nel 2010, nel 2011, nel 2012, nel 2013 e nel 2014 e 500 nel 2015), Total Capital Canada (2.500 nel 2014 e nel 2015) e Total Capital International (850 nel 2015). - 4) Gli importi indicati includono

quelli relativi ad UBS (30 nel 2010 e nel 2011 e 3.750 nel 2015), UBS Filiale del Regno Unito (60 nel 2011, nel 2012 e nel 2013, 3.060 nel 2014 e 4.560 nel 2015) ed UBS Filiale di Saint Helier (70 nel 2010, nel 2011, nel 2012, nel 2013, nel 2014 e nel 2015). - 5) Gli importi indicati includono quelli relativi a Volkswagen Bank (1.000 nel 2010, 1.500 nel 2011 e nel 2012, 500 nel 2013, 600 nel 2014 e 1.850 nel 2015), Volkswagen Financial Service (1.000 nel 2010, nel 2011, nel 2012 e nel 2013 e 1.250 nel 2015), Volkswagen International Finance (1.250 nel 2009, 2.750 nel 2010, 1.250 nel 2011, 4.000 nel 2012, 5.000 nel 2013, 5.850 nel 2014 e 11.200 nel 2015) e Volkswagen Leasing GmbH (3.250 nel 2011, 2.050 nel 2012, 2.000 nel 2013, 3.250 nel 2014 e 5.000 nel 2015).

RENDIMENTO EFFETTIVO MEDIO DI UN GRUPPO
MEDIE MENSILI DALL'OTTOBRE

AVERAGE REDEMPTION YIELD ON SELECTED ITALIAN GOVERNMENT SECURITIES

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
1986								
Ottobre	10,175	10,172	10,213	10,075	10,789	10,980	10,550	10,724
Novembre	10,322	10,361	10,177	10,367	10,613	10,706	10,511	10,525
Dicembre	10,192	10,128	10,182	10,353	10,542	10,659	10,448	10,469
1987								
Gennaio	9,930	10,017	9,444	10,084	10,324	10,292	10,383	10,370
Febbraio	9,895	9,953	9,674	10,108	10,142	10,170	10,463	10,079
Marzo	10,120	10,190	10,075	10,028	10,039	10,086	10,066	9,968
Aprile	10,226	10,185	10,080	10,382	10,009	10,092	10,113	9,904
Maggio	10,387	10,262	10,565	10,754	10,007	10,556	10,054	9,981
Giugno	10,635	10,580	10,662	10,911	10,060	10,055	10,260	9,943
Luglio	11,088	11,119	11,062	11,010	10,322	10,346	10,535	10,245
Agosto	11,525	11,747	11,254	11,230	11,114	11,056	10,960	11,153
Settembre	11,665	11,790	11,618	11,517	11,370	11,387	11,501	11,362
Ottobre	11,514	11,705	11,268	10,894	11,578	11,511	11,633	11,636
Novembre	11,454	11,629	11,245	11,164	11,796	11,696	11,703	11,949
Dicembre	11,061	10,950	11,124	11,913	11,679	12,059	11,560	11,613
1988								
Gennaio	10,884	10,737	10,821	11,635	11,049	10,920	11,115	11,221
Febbraio	10,836	10,913	10,456	11,723	10,761	10,583	10,676	10,953
Marzo	10,812	11,080	10,680	11,055	10,642	10,377	10,503	10,851
Aprile	10,990	11,146	10,978	11,089	10,812	10,402	10,834	10,994
Maggio	11,003	11,161	10,926	11,191	11,059	10,635	11,281	11,339
Giugno	11,035	11,002	11,128	11,242	11,193	10,749	11,292	11,570
Luglio	10,934	11,053	10,714	11,570	11,212	10,669	11,461	11,513
Agosto	11,363	11,508	10,617	11,856	11,414	11,009	11,674	11,638
Settembre	11,291	11,581	10,091	11,860	11,475	11,083	11,670	11,753
Ottobre	11,071	11,238	10,440	11,892	11,717	11,190	11,933	11,965
Novembre	11,266	11,291	11,207	11,895	11,709	11,444	11,825	11,916
Dicembre	11,380	11,357	11,231	11,980	11,685	11,622	11,994	11,708
1989								
Gennaio	11,457	11,457	11,394	11,780	11,800	11,790	12,099	11,829
Febbraio	11,823	11,822	11,454	12,167	11,894	12,218	12,052	11,928
Marzo	12,349	12,424	11,667	12,333	12,300	12,537	12,415	12,476
Aprile	12,362	12,400	11,417	12,578	13,047	13,245	13,075	13,294
Maggio	12,570	12,643	11,284	12,533	12,951	13,217	13,064	13,186
Giugno	12,547	12,562	11,307	12,523	12,814	13,206	12,904	12,897

DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI:
1986 AL GIUGNO 2016

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2016

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
Luglio	12,608	12,640	11,345	12,375	12,367	12,902	12,401	12,453
Agosto	12,840	13,000	11,426	12,538	13,222	13,595	13,236	13,483
Settembre	12,846	13,111	11,374	12,235	13,279	13,641	13,315	13,379
Ottobre	13,029	13,114	11,637	12,474	13,470	13,853	13,477	13,495
Novembre	13,389	13,385	12,348	12,904	13,716	14,188	13,689	13,694
Dicembre	13,277	13,347	12,390	13,007	13,918	14,319	13,887	13,978
1990								
Gennaio	13,260	13,340	12,071	12,752	13,736	14,206	13,593	13,541
Febbraio	13,376	13,377	12,740	13,037	13,661	13,888	13,465	13,450
Marzo	13,438	13,491	12,882	13,182	13,660	13,742	13,566	13,489
Aprile	13,465	13,462	12,800	13,571	13,748	13,838	13,712	13,336
Maggio	13,210	13,224	12,765	13,538	13,559	13,648	13,562	13,152
Giugno	12,610	12,582	12,177	13,308	12,864	13,024	12,731	12,520
Luglio	12,720	12,733	12,259	12,874	12,343	12,402	12,339	12,105
Agosto	13,301	13,476	12,889	13,429	12,448	12,539	12,710	11,776
Settembre	13,502	13,545	12,599	13,425	12,805	12,799	13,129	12,352
Ottobre	13,335	13,408	12,556	13,341	12,676	12,595	12,955	12,601
Novembre	13,367	13,385	12,675	13,380	12,699	12,674	13,065	12,422
Dicembre	13,554	13,605	13,276	13,512	13,083	13,283	13,263	12,482
1991								
Gennaio	13,626	13,605	13,370	13,580	13,534	13,686	13,636	13,141
Febbraio	13,647	13,474	14,041	13,562	13,435	13,507	13,574	13,139
Marzo	13,282	13,181	13,699	13,329	13,466	13,439	13,480	13,633
Aprile	12,937	12,959	13,314	13,036	12,797	12,641	12,862	12,997
Maggio	12,502	12,434	12,786	12,526	12,284	12,239	12,366	12,376
Giugno	12,578	12,350	12,889	12,551	12,079	11,958	12,221	12,020
Luglio	12,701	12,267	13,155	12,392	12,261	12,146	12,459	12,184
Agosto	12,789	12,461	13,208	12,523	12,445	12,386	12,650	12,336
Settembre	12,779	12,474	13,023	12,753	12,613	12,543	12,885	12,348
Ottobre	12,482	12,276	12,831	12,606	12,516	12,402	12,748	12,224
Novembre	12,497	12,117	12,902	12,535	12,409	12,328	12,603	12,128
Dicembre	12,710	12,375	13,013	12,824	12,797	12,695	13,000	12,571
1992								
Gennaio	12,438	12,297	12,603	12,303	12,830	12,665	12,938	12,958
Febbraio	12,341	12,303	12,657	12,289	12,418	12,227	12,695	12,502
Marzo	12,491	12,461	12,682	12,382	12,536	12,364	12,983	12,546
Aprile	12,521	12,375	12,810	12,463	12,912	12,823	13,459	12,847

RENDIMENTO EFFETTIVO MEDIO DI UN GRUPPO
MEDIE MENSILI DALL'OTTOBRE

AVERAGE REDEMPTION YIELD ON SELECTED ITALIAN GOVERNMENT SECURITIES

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
Maggio	12,555	12,471	12,697	12,430	13,176	13,052	13,795	13,166
Giugno	13,051	12,999	13,114	12,986	13,573	13,643	14,047	13,375
Luglio	13,787	13,853	13,769	13,045	14,907	14,880	15,245	14,676
Agosto	14,042	14,101	13,724	13,379	16,101	15,894	16,577	16,030
Settembre	15,185	15,353	14,829	14,154	17,815	17,815	17,908	17,805
Ottobre	14,772	14,853	14,721	14,143	18,693	18,144	19,121	19,508
Novembre	13,868	13,914	13,811	13,456	16,501	16,091	17,209	16,834
Dicembre	13,973	14,126	13,940	13,641	16,276	15,846	17,075	16,465
Gennaio	13,311	13,406	13,505	13,172	14,946	14,404	15,562	15,299
Febbraio	12,901	12,827	13,011	13,002	13,886	13,095	14,266	14,549
Marzo	12,779	12,701	12,955	12,833	13,536	12,966	13,949	13,962
Aprile	12,866	12,969	12,967	12,823	13,839	13,478	14,498	13,890
1993								
Maggio	12,285	12,360	12,415	12,508	13,155	12,721	13,343	13,866
Giugno	11,837	11,829	11,981	12,059	12,400	11,889	12,430	13,260
Luglio	10,912	10,805	11,096	11,240	11,364	10,798	11,705	12,047
Agosto	10,139	10,099	10,280	10,307	10,987	10,689	11,378	11,411
Settembre	9,712	9,714	9,926	9,780	10,263	10,228	10,551	10,538
Ottobre	9,166	9,182	9,537	9,211	9,405	9,394	9,733	9,555
Novembre	9,603	9,539	9,816	9,703	9,565	9,652	9,820	9,582
Dicembre	9,338	9,309	9,605	9,437	9,749	9,734	9,975	10,000
1994								
Gennaio	8,852	8,814	9,097	8,916	8,922	8,865	9,221	9,134
Febbraio	9,100	8,948	10,303	9,067	9,044	9,091	9,231	9,201
Marzo	9,663	9,601	9,979	9,787	9,292	9,427	9,297	9,454
Aprile	9,367	9,309	9,758	9,474	9,389	9,530	9,475	9,640
Maggio	9,435	9,405	10,220	9,592	9,143	9,296	9,250	9,371
Giugno	10,289	10,257	11,098	10,403	9,082	9,212	9,125	9,354
Luglio	10,668	10,785	11,409	10,501	9,863	10,065	9,923	9,934
Agosto	11,599	11,650	12,069	11,441	10,455	10,588	10,498	10,587
Settembre	11,976	12,048	12,528	11,727	11,440	11,635	11,480	11,329
Ottobre	11,892	11,883	12,161	11,872	11,159	11,276	11,424	11,017
Novembre	11,692	11,660	11,535	11,844	11,287	11,471	11,578	11,076
Dicembre	11,813	11,795	11,576	11,937	11,131	11,285	11,462	10,581
1995								
Gennaio	11,896	11,887	12,138	12,037	11,191	11,405	11,343	10,740
Febbraio	11,851	11,838	12,161	12,068	11,201	11,390	11,353	10,747
Marzo	12,722	12,597	12,985	12,951	11,631	12,009	11,480	10,895

DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI:
1986 AL GIUGNO 2016

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2016

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
Aprile	12,706	12,632	12,723	13,000	12,845	12,987	12,867	12,650
Maggio	11,983	11,963	12,080	12,275	12,558	12,470	12,802	12,538
Giugno	12,058	12,035	12,146	12,296	11,975	11,804	12,264	12,036
Giugno	12,058	12,035	12,146	12,296	11,975	11,804	12,264	12,036
Luglio	11,950	11,927	11,921	12,165	12,105	12,021	12,296	12,088
Agosto	11,530	11,485	11,537	11,787	11,981	11,882	12,158	12,019
Settembre	11,345	11,291	11,447	11,623	11,567	11,490	11,707	11,562
Ottobre	11,477	11,394	11,621	11,893	11,542	11,419	11,689	11,340
Novembre	11,303	11,235	11,378	11,621	11,752	11,590	11,940	11,599
Dicembre	10,980	10,913	11,091	11,232	11,308	11,168	11,445	11,406
Gennaio	10,225	10,035	10,322	10,408	10,890	10,701	11,027	11,056
Febbraio	10,122	9,823	10,238	10,336	10,140	9,871	10,284	10,333
Marzo	10,294	10,000	10,384	10,488	10,239	9,767	10,530	10,175
Aprile	10,083	9,914	10,316	10,235	10,051	9,521	10,366	10,204
Maggio	9,402	9,224	9,547	9,561	9,421	8,941	9,580	9,916
1996								
Giugno	9,184	8,911	9,484	9,356	8,957	8,646	9,079	9,146
Luglio	9,004	8,718	9,195	9,138	8,652	8,319	8,782	8,937
Agosto	9,034	8,743	9,193	9,148	8,626	7,979	9,001	8,868
Settembre	8,873	8,686	9,088	8,973	8,622	7,882	9,095	8,910
Ottobre	8,140	7,781	8,062	8,279	8,361	8,104	8,541	8,610
Novembre	7,424	7,074	7,369	7,581	7,715	7,077	7,738	8,103
Dicembre	7,299	6,956	7,234	7,521	7,160	6,993	7,350	7,606
1997								
Gennaio	7,081	6,744	7,063	7,288	7,011	6,980	7,094	7,307
Febbraio	7,237	6,964	7,313	7,374	7,102	7,019	7,198	7,278
Marzo	7,716	7,480	7,801	7,856	7,387	7,334	7,476	7,367
Aprile	7,601	7,317	7,698	7,791	7,691	7,679	7,759	7,585
Maggio	7,352	7,023	7,344	7,553	7,292	7,380	7,244	7,327
Giugno	7,253	6,828	7,212	7,444	7,066	7,122	7,055	7,059
Luglio	6,855	6,330	6,900	7,059	7,062	7,099	7,038	7,139
Agosto	6,868	6,524	6,822	7,183	7,017	7,051	7,012	7,155
Settembre	6,574	6,135	6,501	6,880	6,922	6,975	6,894	7,140
Ottobre	6,340	5,908	6,188	6,633	6,509	6,571	6,442	6,888
Novembre	6,208	5,807	6,338	6,486	6,482	6,550	6,433	6,753
Dicembre	5,691	5,451	5,860	5,892	6,234	6,274	6,221	6,291
1998								
Gennaio	5,444	5,235	5,614	5,587	5,751	5,786	5,701	6,070
Febbraio	5,549	5,298	5,721	5,672	6,112	6,154	6,092	6,132
Marzo	5,461	5,129	5,699	5,607	6,084	6,103	6,067	6,171
Aprile	5,416	5,162	5,624	5,551	5,578	5,527	5,572	5,682
Maggio	5,457	5,208	5,568	5,626	5,359	5,302	5,372	5,354

RENDIMENTO EFFETTIVO MEDIO DI UN GRUPPO
MEDIE MENSILI DALL'OTTOBRE

AVERAGE REDEMPTION YIELD ON SELECTED ITALIAN GOVERNMENT SECURITIES

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
Giugno	5,383	5,134	5,506	5,543	5,271	5,211	5,269	5,294
Luglio	5,241	5,274	5,231	5,363	5,178	5,112	5,189	5,320
Agosto	5,044	5,005	5,141	5,133	5,018	4,902	4,992	5,365
Settembre	4,868	4,765	4,975	5,018	4,970	4,881	4,926	5,391
Ottobre	4,784	4,600	4,907	4,994	4,778	4,660	4,753	5,278
Novembre	4,684	4,387	4,713	4,995	4,482	4,341	4,495	4,987
Dicembre	4,361	3,818	4,324	4,774	4,078	3,995	3,978	4,584
Gennaio	4,246	3,596	4,302	4,645	3,492	3,333	3,460	4,023
Febbraio	4,364	3,787	4,458	4,739	3,434	3,407	3,404	3,656
Marzo	4,607	3,996	4,712	4,968	3,408	3,375	3,406	3,608
Aprile	4,387	3,690	4,523	4,863	3,344	3,317	3,324	3,600
Maggio	4,525	3,830	4,554	5,073	3,016	2,981	3,066	3,238
Giugno	4,818	4,155	5,176	5,317	3,017	3,005	3,056	3,214
1999								
Luglio	5,169	4,618	5,484	5,568	3,277	3,307	3,232	3,493
Agosto	5,344	4,788	5,601	5,718	3,426	3,539	3,259	3,475
Settembre	5,481	4,876	5,757	5,810	3,447	3,509	3,327	3,713
Ottobre	5,685	5,203	6,008	6,075	3,515	3,580	3,419	3,720
Novembre	5,535	5,114	5,907	6,057	3,980	4,057	3,846	4,091
Dicembre	5,638	5,189	6,092	6,015	4,053	4,131	3,832	4,304
2000								
Gennaio	5,876	5,379	6,440	6,383	4,118	4,199	3,822	4,466
Febbraio	5,913	5,463	6,450	6,377	4,148	4,219	3,882	4,560
Marzo	5,855	5,423	6,311	6,199	4,348	4,416	4,090	4,685
Aprile	5,851	5,434	6,255	6,161	4,580	4,662	4,332	4,878
Maggio	6,171	5,859	6,369	6,501	4,827	4,926	4,518	4,959
Giugno	6,093	5,852	6,305	6,392	5,232	5,358	4,922	5,393
Luglio	6,171	6,012	6,516	6,407	5,309	5,432	4,993	5,567
Agosto	6,157	6,072	6,504	6,310	5,456	5,533	5,210	5,605
Settembre	6,162	6,054	6,603	6,318	5,587	5,660	5,369	5,801
Ottobre	6,218	6,196	6,425	6,425	5,682	5,766	5,412	5,795
Novembre	6,219	6,381	6,367	6,383	5,643	5,682	5,471	5,936
Dicembre	5,851	5,678	6,127	6,053	5,594	5,648	5,438	5,908
2001								
Gennaio	5,660	5,610	6,076	5,909	5,413	5,529	5,178	5,686
Febbraio	5,685	5,411	6,308	5,928	5,224	5,325	5,090	5,478
Marzo	5,667	5,489	6,051	5,878	5,295	5,419	5,226	5,323

DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI:
1986 AL GIUGNO 2016

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2016

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
Aprile	5,731	5,801	5,886	5,880	5,313	5,588	4,974	5,382
Maggio	5,896	6,272	5,426	6,031	5,227	5,418	5,051	5,291
Giugno	5,742	5,755	5,293	6,166	5,087	5,111	4,911	5,186
Luglio	5,815	5,569	5,363	6,086	4,922	4,647	4,682	5,221
Agosto	5,965	6,288	5,229	6,004	4,941	4,562	4,675	5,308
Settembre	5,837	6,356	5,108	5,940	4,673	4,561	4,714	5,212
Ottobre	5,279	5,199	4,818	5,630	4,337	3,873	4,156	5,027
Novembre	5,040	4,499	4,653	5,477	4,082	3,686	3,776	4,680
Dicembre	5,135	4,899	4,968	5,598	3,855	3,481	3,788	4,349
2002								
Gennaio	5,265	5,266	4,842	5,649	3,870	3,393	3,642	4,452
Febbraio	5,297	5,180	4,931	5,717	3,909	3,538	3,685	4,303
Marzo	5,435	5,044	5,139	5,907	3,909	3,538	3,685	4,303
Aprile	5,471	5,059	5,205	5,932	4,123	3,738	3,876	4,467
Maggio	5,471	5,053	5,189	5,935	3,822	3,685	3,830	4,138
Giugno	5,331	4,911	5,076	5,863	3,850	3,826	3,784	4,241
Luglio	5,257	4,911	4,893	5,676	3,804	3,715	3,713	4,528
Agosto	5,082	4,727	4,553	5,460	3,669	3,519	3,646	4,317
Settembre	4,947	4,359	4,351	5,473	3,712	3,486	3,649	4,320
Ottobre	4,948	4,196	4,422	5,499	3,608	3,381	3,570	4,602
Novembre	5,004	4,100	4,458	5,644	3,574	3,487	3,540	4,504
Dicembre	4,849	3,914	4,416	5,527	3,388	3,243	3,383	4,506
2003								
Gennaio	4,685	3,629	4,132	5,419	3,217	3,200	3,189	4,184
Febbraio	4,429	3,317	3,980	5,270	3,078	3,024	3,017	4,189
Marzo	4,424	3,485	4,052	5,092	2,865	2,985	2,725	3,939
Aprile	4,473	3,554	4,167	5,233	2,887	2,977	2,652	3,927
Maggio	4,232	3,192	4,030	4,982	2,687	2,635	2,644	4,097
Giugno	4,094	2,821	3,715	4,954	2,518	2,462	2,415	3,904
Luglio	4,248	3,145	4,052	5,131	2,359	2,413	2,164	3,612
Agosto	4,373	3,486	4,213	5,224	2,345	2,275	2,250	3,691
Settembre	4,472	3,519	4,454	5,002	2,385	2,319	2,315	3,723
Ottobre	4,432	3,610	4,446	4,997	2,373	2,306	2,320	3,938
Novembre	4,483	3,750	4,720	5,174	2,691	2,828	2,335	3,985
Dicembre	4,421	3,687	4,673	5,134	2,443	2,477	2,346	3,588
2004								
Gennaio	4,412	3,543	4,665	5,293	2,487	2,345	2,291	3,754
Febbraio	4,358	3,473	4,349	5,143	2,260	2,066	2,256	3,943

RENDIMENTO EFFETTIVO MEDIO DI UN GRUPPO
MEDIE MENSILI DALL'OTTOBRE

AVERAGE REDEMPTION YIELD ON SELECTED ITALIAN GOVERNMENT SECURITIES

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
Marzo	4,238	3,272	4,012	5,025	2,226	2,113	2,211	3,852
Aprile	4,445	3,338	4,172	5,206	2,183	2,085	2,055	3,802
Maggio	4,487	3,484	4,240	5,313	2,391	2,286	2,234	4,016
Giugno	4,620	3,557	4,535	5,395	2,429	2,292	2,211	4,130
Luglio	4,482	3,413	4,603	5,181	2,459	2,291	2,338	4,044
Agosto	4,459	3,291	4,692	5,007	2,416	2,280	2,321	3,871
Settembre	4,538	3,268	4,824	4,974	2,456	2,295	2,422	3,889
Ottobre	4,330	3,142	4,548	4,812	2,430	2,315	2,269	3,767
Novembre	4,365	3,102	5,500	4,599	2,467	2,328	2,284	3,639
Dicembre	4,237	2,997	5,630	4,394	2,446	2,276	2,249	3,569
2005								
Gennaio	4,097	2,964	5,091	4,276	2,503	2,262	2,244	3,515
Febbraio	4,284	2,949	5,781	4,152	2,457	2,242	2,282	3,414
Marzo	4,223	3,018	5,277	4,275	2,433	2,250	2,258	3,410
Aprile	4,175	2,850	5,649	4,106	2,405	2,258	2,253	3,327
Maggio	3,952	2,676	5,382	3,977	2,529	2,452	2,268	3,218
Giugno	3,761	2,541	4,811	3,907	2,326	2,168	2,223	3,165
Luglio	3,897	2,558	5,199	3,918	2,325	2,179	2,224	3,133
Agosto	4,046	2,603	5,294	3,903	2,325	2,198	2,241	3,093
Settembre	3,746	2,526	4,787	3,747	2,417	2,225	2,266	3,106
Ottobre	3,821	2,821	4,737	3,833	2,490	2,307	2,324	3,180
Novembre	4,005	3,186	5,047	4,071	2,610	2,338	2,395	3,389
Dicembre	3,854	3,196	4,702	3,974	2,625	2,417	2,436	3,473
2006								
Gennaio	3,852	3,263	4,561	3,942	2,769	2,684	2,552	3,412
Febbraio	3,850	3,310	4,524	3,943	2,789	2,769	2,673	3,517
Marzo	3,882	3,535	4,262	4,018	2,834	2,814	2,513	3,667
Aprile	4,078	3,745	4,368	4,301	2,954	2,909	2,699	3,884
Maggio	4,171	3,812	4,538	4,362	3,006	2,979	2,801	3,967
Giugno	4,105	3,847	4,387	4,350	3,026	3,101	2,708	3,919
Luglio	4,211	3,907	4,572	4,494	3,065	3,107	2,722	3,906
Agosto	4,184	3,837	4,399	4,507	3,182	3,329	2,745	3,867
Settembre	4,233	4,344	4,377	4,340	3,190	3,198	3,252	3,698
Ottobre	4,283	4,676	4,360	4,292	3,533	3,298	3,497	3,781
Novembre	4,191	4,586	3,900	4,201	3,784	3,685	3,696	3,995
Dicembre	4,281	4,632	3,897	4,253	3,764	3,744	3,756	3,912

DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI:
1986 AL GIUGNO 2016

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2016

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
2007								
Gennaio	4,543	4,722	4,072	4,570	3,910	3,847	3,867	4,113
Febbraio	4,628	4,627	4,174	4,869	4,024	3,897	3,948	4,290
Marzo	4,364	4,389	4,086	4,486	4,009	3,985	3,947	4,189
Aprile	4,473	4,428	4,300	4,573	4,091	4,056	4,095	4,275
Maggio	4,603	4,592	4,442	4,679	4,120	4,116	4,169	4,400
Giugno	4,882	4,931	4,707	4,938	4,336	4,246	4,385	4,701
Luglio	4,876	4,931	4,703	4,936	4,370	4,285	4,396	4,710
Agosto	4,758	4,847	4,498	4,834	4,452	4,388	4,485	4,784
Settembre	4,698	4,787	4,423	4,768	4,472	4,460	4,500	4,691
Ottobre	4,693	4,737	4,476	4,827	4,516	4,484	4,506	4,859
Novembre	4,603	4,553	4,251	4,756	4,498	4,507	4,456	4,876
Dicembre	4,683	4,597	4,433	4,835	4,563	4,475	4,621	5,185
2008								
Gennaio	4,458	4,180	4,195	4,762	4,518	4,452	4,400	5,400
Febbraio	4,441	4,071	4,002	4,718	4,450	4,133	4,642	5,313
Marzo	4,433	4,309	4,022	4,581	4,552	4,246	4,969	5,042
Aprile	4,587	4,430	4,310	4,764	4,700	4,417	5,061	5,181
Maggio	4,821	4,638	4,391	5,002	4,812	4,425	5,269	5,241
Giugno	5,165	5,155	4,931	5,182	4,897	4,632	5,246	5,561
Luglio	5,211	5,260	4,950	5,195	5,021	4,727	5,601	5,921
Agosto	4,907	4,779	4,601	5,017	5,338	4,829	6,397	5,960
Settembre	5,064	5,000	4,558	5,092	5,459	4,883	6,714	6,042
Ottobre	5,320	5,777	4,473	4,970	5,749	5,075	7,541	6,201
Novembre	4,945	4,493	4,195	4,864	5,354	4,581	6,619	5,584
Dicembre	4,517	3,861	4,223	4,774	5,084	4,535	6,009	5,441
2009								
Gennaio	4,322	3,428	4,125	4,847	3,594	3,446	3,709	5,132
Febbraio	4,178	3,206	4,047	4,715	3,060	3,094	3,109	5,060
Marzo	4,237	3,235	4,102	4,660	2,794	2,840	2,850	5,012
Aprile	4,043	3,138	3,922	4,684	2,471	2,581	2,444	4,863
Maggio	4,084	3,116	3,920	4,827	2,280	2,472	2,236	4,623
Giugno	4,102	3,270	4,022	4,887	2,233	2,305	2,224	4,714
Luglio	4,021	2,945	3,798	4,726	2,084	2,294	2,003	4,539
Agosto	4,113	2,823	3,441	4,644	1,855	2,158	1,593	4,386
Settembre	3,975	2,765	3,416	4,587	1,838	2,208	1,545	4,110
Ottobre	4,004	3,671	3,233	4,537	1,707	1,633	1,497	3,992
Novembre	4,119	5,519	2,805	4,500	1,656	1,831	1,378	3,970
Dicembre	4,028	4,936	2,988	4,581	1,667	1,496	1,425	3,806

RENDIMENTO EFFETTIVO MEDIO DI UN GRUPPO
MEDIE MENSILI DALL'OTTOBRE

AVERAGE REDEMPTION YIELD ON SELECTED ITALIAN GOVERNMENT SECURITIES

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
2010								
Gennaio	4,183	4,272	3,347	4,648	1,513	1,460	1,312	3,522
Febbraio	4,174	4,377	3,251	4,578	1,558	1,431	1,387	3,512
Marzo	4,177	3,805	3,906	4,434	1,545	1,368	1,359	3,359
Aprile	4,189	3,436	3,646	4,550	1,658	1,460	1,372	3,280
Maggio	4,340	4,430	3,419	4,580	1,881	1,693	1,633	3,504
Giugno	4,225	3,615	3,304	4,687	1,909	1,719	1,802	3,660
Luglio	4,083	3,181	3,544	4,720	1,994	1,896	1,635	4,042
Agosto	4,014	3,000	3,500	4,488	1,981	1,839	1,487	4,033
Settembre	3,981	3,145	3,340	4,566	2,236	1,944	2,241	3,546
Ottobre	3,816	2,960	3,506	4,302	2,299	2,045	1,949	6,213
Novembre	4,170	3,179	3,762	4,617	2,435	2,155	1,866	6,775
Dicembre	4,482	3,299	3,987	5,015	2,766	2,287	2,665	7,149
2011								
Gennaio	4,597	3,382	4,190	5,097	2,832	2,203	3,226	7,200
Febbraio	4,531	3,463	4,296	5,053	2,952	2,367	3,178	7,303
Marzo	4,723	3,610	4,646	5,217	2,776	2,594	2,570	7,224
Aprile	4,715	3,577	4,802	5,124	2,631	2,425	2,394	7,754
Maggio	4,618	3,617	4,773	5,104	2,598	2,368	2,546	7,520
Giugno	4,773	3,782	4,859	5,209	2,865	2,681	2,748	7,153
Luglio	5,087	4,286	4,703	5,629	3,458	3,265	3,445	7,675
Agosto	5,133	4,586	4,753	5,691	4,029	3,792	4,126	7,335
Settembre	5,236	4,488	4,691	5,932	4,864	4,653	4,763	7,146
Ottobre	5,539	4,915	5,083	6,128	4,804	4,553	4,822	7,531
Novembre	6,146	5,021	5,764	7,015	5,941	5,690	5,918	7,754
Dicembre	6,418	5,084	6,630	7,272	6,516	6,448	6,329	8,558
2012								
Gennaio	5,819	4,674	5,894	6,791	5,868	5,367	6,434	7,741
Febbraio	5,073	4,151	4,888	5,776	4,759	4,298	5,058	6,485
Marzo	4,848	3,856	5,010	5,360	3,918	3,378	4,512	5,816
Aprile	5,075	4,563	4,985	5,843	4,646	4,101	4,358	6,330
Maggio	5,125	4,643	5,102	5,943	5,012	4,437	4,549	6,411
Giugno	5,349	4,827	5,281	6,065	5,641	5,283	5,149	6,354
Luglio	5,239	4,739	5,204	6,069	5,631	5,754	5,229	6,354
Agosto	5,015	4,407	4,849	5,918	5,144	5,230	4,543	6,259
Settembre	4,490	3,762	4,409	5,413	4,206	4,432	4,066	5,706
Ottobre	4,335	3,424	4,224	5,134	3,996	4,288	3,564	5,243
Novembre	4,239	3,335	4,072	5,019	3,859	3,978	3,441	4,869
Dicembre	4,497	4,191	4,030	4,968	3,846	3,927	2,946	4,824

DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI:
1986 AL GIUGNO 2016

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2016

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
2013								
Gennaio	4,401	4,636	3,528	4,708	3,572	3,389	3,069	4,553
Febbraio	4,400	3,977	3,870	4,896	3,635	3,373	3,398	4,695
Marzo	4,199	3,368	4,076	4,950	3,647	3,358	3,945	4,703
Aprile	3,997	3,044	3,749	4,713	3,508	3,240	4,166	4,574
Maggio	3,822	2,647	3,496	4,575	3,190	3,147	3,999	4,283
Giugno	4,030	3,098	3,980	4,692	3,233	3,156	4,463	4,434
Luglio	4,064	3,043	3,871	4,769	3,250	2,790	4,293	4,353
Agosto	4,171	2,830	4,038	4,843	2,842	2,399	4,057	4,331
Settembre	4,301	3,487	3,949	4,920	2,598	2,219	3,036	4,496
Ottobre	4,112	3,240	3,825	4,748	2,387	2,132	2,638	4,345
Novembre	3,860	2,854	3,524	4,640	2,229	2,047	3,446	4,310
Dicembre	3,989	3,354	3,963	4,597	2,241	1,948	3,596	4,315
2014								
Gennaio	4,186	4,294	4,046	4,359	2,245	1,791	3,287	3,934
Febbraio	3,923	4,034	3,741	4,026	2,031	1,585	2,777	3,761
Marzo	3,820	3,779	3,613	3,956	1,954	1,465	2,690	3,772
Aprile	3,433	3,177	3,173	3,850	2,110	1,502	2,447	3,881
Maggio	3,413	3,403	3,035	3,719	2,042	1,657	2,042	3,741
Giugno	3,210	3,340	2,744	3,500	1,891	1,527	2,155	3,504
Luglio	3,002	1,873	2,784	3,438	1,753	1,395	2,462	3,125
Agosto	3,043	1,919	3,050	3,302	1,796	1,508	2,199	2,936
Settembre	2,810	1,520	2,752	3,209	1,573	1,345	1,938	2,715
Ottobre	2,993	2,068	2,899	3,302	1,909	1,981	2,175	2,890
Novembre	2,821	2,497	2,674	3,003	1,830	2,138	1,881	2,587
Dicembre	3,359	2,871	2,286	3,299	1,803	1,574	2,109	2,615
2015								
Gennaio	3,075	3,063	2,154	3,081	1,856	1,728	1,892	2,425
Febbraio	2,892	3,918	1,889	2,789	1,756	1,618	1,849	2,167
Marzo	2,438	3,348	1,702	2,328	2,158	2,778	1,853	1,993
Aprile	2,992	4,610	1,714	2,492	2,152	4,592	2,039	1,272
Maggio	3,033	3,845	1,800	2,756	1,851	2,071	2,251	1,238
Giugno	3,203	3,971	2,112	2,956	1,689	1,966	1,947	2,294
Luglio	2,399	1,910	2,219	2,501	1,849	1,856	1,795	3,015
Agosto	2,956	5,449	1,922	2,726	1,564	1,430	1,497	2,050
Settembre	3,033	4,407	2,343	2,978	1,685	2,324	1,647	2,286
Ottobre	2,625	3,334	2,322	2,575	1,650	1,430	1,775	2,452
Novembre	2,602	3,214	2,215	2,590	1,553	1,367	1,480	2,403
Dicembre	2,628	3,325	2,291	2,569	1,722	0,982	2,067	2,428

RENDIMENTO EFFETTIVO MEDIO DI UN GRUPPO
MEDIE MENSILI DALL'OTTOBRE

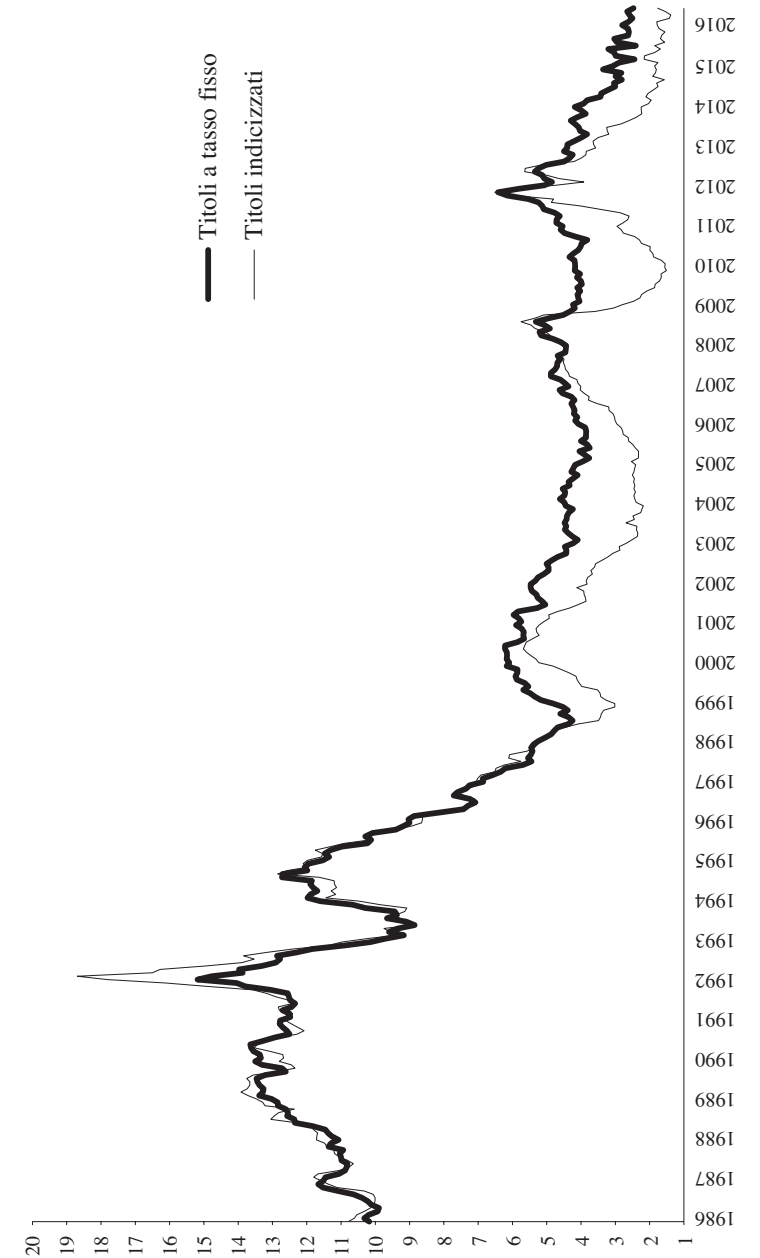
AVERAGE REDEMPTION YIELD ON SELECTED ITALIAN GOVERNMENT SECURITIES

DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI:
1986 AL GIUGNO 2016

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2016

Anno e mese	Titoli a tasso fisso				Titoli indicizzati			
	Media	Durata residua			Media	Durata residua		
		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni		da più di 3 anni a 5 anni	da più di 5 anni a 7 anni	oltre 7 anni
2016								
Gennaio	2,801	4,021	2,571	2,500	1,779	1,360	2,076	2,370
Febbraio	2,617	3,815	2,602	2,395	1,792	1,350	2,061	2,329
Marzo	2,498	3,645	2,211	2,237	1,425	1,007	1,797	2,275
Aprile	2,588	2,601	2,208	2,576	1,382	0,877	1,738	2,122
Maggio	2,655	1,709	2,046	2,818	1,542	0,832	1,935	2,320
Giugno	2,470	1,479	1,756	2,654	1,763	1,278	1,833	2,770

RENDIMENTO EFFETTIVO MEDIO DI UN GRUPPO DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI



CONFRONTO TRA IL TASSO D'INFLAZIONE, IL RENDIMENTO
DELLE OBBLIGAZIONI EMESSE DALLE
INFLATION RATE, ORDINARY TREASURY BILL YIELD

Anno e mese	Tasso d'inflazione	Rendimento BOT	MFI	Anno e mese	Tasso d'inflazione	Rendimento BOT	MFI
	(1)	(2)	(3)		(1)	(2)	(3)
(dati medi mensili)				(dati medi mensili)			
2006				2008			
Gennaio	2,18	2,72	3,14	Gennaio	2,88	3,95	3,16
Febbraio	2,09	2,77	3,16	Febbraio	2,87	3,41	3,21
Marzo	2,09	2,94	3,06	Marzo	3,26	3,79	3,18
Aprile	2,00	3,06	3,07	Aprile	3,33	3,95	3,18
Maggio	2,16	3,25	3,10	Maggio	3,55	4,03	3,17
Giugno	2,08	3,21	3,13	Giugno	3,77	4,58	3,20
Luglio	2,07	3,43	3,08	Luglio	3,99	4,53	3,20
Agosto	2,07	3,45	3,11	Agosto	3,91	4,30	3,22
Settembre	1,99	3,60	3,14	Settembre	3,68	4,31	3,24
Ottobre	1,67	3,63	3,17	Ottobre	3,36	3,06	3,22
Novembre	1,74	3,70	3,13	Novembre	2,59	2,64	3,25
Dicembre	1,66	3,73	3,13	Dicembre	2,05	2,63	3,20
<i>Media</i>	<i>1,98</i>	<i>3,29</i>	<i>3,12</i>	<i>Media</i>	<i>3,27</i>	<i>3,76</i>	<i>3,20</i>
<i>MediaVariaz. 06/05</i>	<i>0,24</i>	<i>1,06</i>	<i>-0,11</i>	<i>Variaz. 08/07</i>	<i>1,56</i>	<i>-0,32</i>	<i>0,06</i>
2007				2009			
Gennaio	1,50	3,88	3,14	Gennaio	1,51	1,84	3,21
Febbraio	1,50	3,92	3,20	Febbraio	1,51	1,37	3,26
Marzo	1,49	3,95	3,13	Marzo	0,98	1,32	3,15
Aprile	1,41	4,09	3,14	Aprile	0,97	1,36	3,19
Maggio	1,41	4,18	3,12	Maggio	0,67	1,14	3,12
Giugno	1,56	4,34	3,13	Giugno	0,37	1,27	3,13
Luglio	1,56	4,38	3,12	Luglio	-0,07	0,86	3,08
Agosto	1,56	4,25	3,14	Agosto	0,22	0,95	3,05
Settembre	1,56	4,04	3,16	Settembre	0,15	0,74	3,06
Ottobre	2,03	4,01	3,14	Ottobre	0,22	0,92	3,00
Novembre	2,34	4,00	3,17	Novembre	0,67	0,86	3,00
Dicembre	2,65	4,01	3,13	Dicembre	0,97	1,02	2,96
<i>Media</i>	<i>1,71</i>	<i>4,09</i>	<i>3,14</i>	<i>Media</i>	<i>0,68</i>	<i>1,14</i>	<i>3,10</i>
<i>Variaz. 07/06</i>	<i>-0,27</i>	<i>0,80</i>	<i>0,02</i>	<i>Variaz. 09/08</i>	<i>-2,59</i>	<i>-2,63</i>	<i>-0,10</i>

DEI BUONI ORDINARI DEL TESORO E IL RENDIMENTO
BANCHE, DAL GENNAIO 2006 AL GIUGNO 2016
AND BANK BOND YIELD FROM JANUARY 2006 TO JUNE 2016

Anno e mese	Tasso d'inflazione	Rendimento BOT	MFI	Anno e mese	Tasso d'inflazione	Rendimento BOT	MFI
	(1)	(2)	(3)		(1)	(2)	(3)
(dati medi mensili)				(dati medi mensili)			
2010				2012			
Gennaio	1,34	0,80	2,85	Gennaio	3,16	2,74	2,85
Febbraio	1,26	0,97	2,89	Febbraio	3,25	2,23	2,87
Marzo	1,49	0,90	2,80	Marzo	3,24	1,41	2,87
Aprile	1,63	0,93	2,80	Aprile	3,22	2,84	2,88
Maggio	1,48	1,44	2,77	Maggio	3,02	2,34	2,86
Giugno	1,33	1,38	2,80	Giugno	3,12	3,97	2,87
Luglio	1,70	1,40	2,81	Luglio	2,92	2,70	2,84
Agosto	1,55	1,37	2,80	Agosto	3,00	2,77	2,83
Settembre	1,55	1,43	2,81	Settembre	3,10	1,69	2,85
Ottobre	1,70	1,44	2,78	Ottobre	2,50	1,94	2,79
Novembre	1,70	1,78	2,80	Novembre	2,21	1,76	2,80
Dicembre	1,91	2,01	2,78	Dicembre	2,21	1,46	2,78
<i>Media</i>	<i>1,55</i>	<i>1,32</i>	<i>2,81</i>	<i>Media</i>	<i>2,91</i>	<i>2,32</i>	<i>2,84</i>
<i>Variaz. 10/09</i>	<i>0,87</i>	<i>0,18</i>	<i>-0,29</i>	<i>Variaz. 12/11</i>	<i>0,06</i>	<i>-0,90</i>	<i>0,01</i>
2011				2013			
Gennaio	2,22	2,07	2,79	Gennaio	2,20	0,86	2,76
Febbraio	2,42	1,86	2,81	Febbraio	1,81	1,09	2,80
Marzo	2,63	2,10	2,79	Marzo	1,62	1,28	2,75
Aprile	2,73	1,98	2,81	Aprile	1,14	0,92	2,74
Maggio	2,73	2,11	2,81	Maggio	1,23	0,70	2,71
Giugno	2,83	2,15	2,83	Giugno	1,23	0,96	2,71
Luglio	2,73	3,67	2,85	Luglio	1,23	1,08	2,69
Agosto	2,83	2,96	2,84	Agosto	1,13	1,05	2,68
Settembre	3,14	4,15	2,86	Settembre	0,75	1,34	2,69
Ottobre	3,35	3,57	2,85	Ottobre	0,66	1,00	2,65
Novembre	3,35	6,09	2,87	Novembre	0,56	0,69	2,65
Dicembre	3,25	5,95	2,85	Dicembre	0,56	0,71	2,62
<i>Media</i>	<i>2,85</i>	<i>3,22</i>	<i>2,83</i>	<i>Media</i>	<i>1,18</i>	<i>0,97</i>	<i>2,70</i>
<i>Variaz. 11/10</i>	<i>1,30</i>	<i>1,90</i>	<i>0,02</i>	<i>Variaz. 13/12</i>	<i>-1,74</i>	<i>-1,35</i>	<i>-0,14</i>

1) Variazione dell'indice Istat dei prezzi al consumo per le famiglie di operai e impiegati rispetto allo stesso mese dell'anno precedente. -
2) Rendimento netto (lordo dal luglio 1999) dei Buoni Ordinari del Tesoro a 12 mesi (media delle aste di metà e fine mese). -
3) Rendimento lordo delle obbligazioni emesse dalle banche. - 4) Tasso d'interesse MFI - Monetary Financial Institutions (pubblicato dalla Banca Centrale Europea) corrisposto dalle imprese finanziarie dell'area euro alle famiglie e alle imprese non finanziarie sui depositi a termine in essere, con scadenza superiore ai 2 anni.

1) Variazione dell'indice Istat dei prezzi al consumo per le famiglie di operai e impiegati rispetto allo stesso mese dell'anno precedente. -
2) Rendimento lordo dei Buoni Ordinari del Tesoro a 12 mesi (media delle aste di metà e fine mese). - 3) Tasso d'interesse MFI - Monetary Financial Institutions (pubblicato dalla Banca Centrale Europea) corrisposto dalle imprese finanziarie dell'area euro alle famiglie e alle imprese non finanziarie sui depositi a termine in essere, con scadenza superiore ai 2 anni.

CONFRONTO TRA IL TASSO D'INFLAZIONE, IL RENDIMENTO
DELLE OBBLIGAZIONI EMESSE DALLE
INFLATION RATE, ORDINARY TREASURY BILL YIELD

Anno e mese	Tasso d'inflazione (1)	Rendimento BOT (2)	MFI (3)	Anno e mese	Tasso d'inflazione (1)	Rendimento BOT (2)	MFI (3)
(dati medi mensili)			(dati medi mensili)				
2014			2016				
Gennaio	0,56	0,74	2,60	Gennaio	0,26	0,07	2,17
Febbraio	0,47	0,68	2,63	Febbraio	-0,22	0,03	2,18
Marzo	0,28	0,59	2,58	Marzo	-0,31	0,07	2,13
Aprile	0,47	0,59	2,57	Aprile	-0,40	0,08	2,13
Maggio	0,37	0,65	2,53	Maggio	-0,39	0,14	2,09
Giugno	0,28	0,50	2,52	Giugno	-0,29	0,12	2,09
Luglio	0,09	0,39	2,48	<i>Media</i>	-0,22	0,09	2,13
Agosto	-0,09	0,28	2,47				
Settembre	-0,09	0,27	2,47				
Ottobre	0,09	0,30	2,43				
Novembre	0,19	0,34	2,43				
Dicembre	-0,09	0,42	2,40				
<i>Media</i>	0,21	0,48	2,51				
<i>Variaz. 14/13</i>	-0,97	-0,50	-0,20				
2015							
Gennaio	-0,75	0,24	2,37				
Febbraio	-0,37	0,21	2,42				
Marzo	-0,19	0,08	2,36				
Aprile	-0,28	0,01	2,35				
Maggio	-0,09	0,03	2,32				
Giugno	-0,09	0,06	2,32				
Luglio	-0,09	0,12	2,28				
Agosto	-0,09	0,01	2,27				
Settembre	-0,09	0,03	2,26				
Ottobre	0,00	0,02	2,24				
Novembre	0,00	0,03	2,21				
Dicembre	0,00	0,00	2,20				
<i>Media</i>	-0,30	0,10	2,36				
<i>Variaz. 15/14</i>	-0,51	-0,37	-0,15				

1) Variazione dell'indice Istat dei prezzi al consumo per le famiglie di operai e impiegati rispetto allo stesso mese dell'anno precedente. -
2) Rendimento lordo dei Buoni Ordinari del Tesoro a 12 mesi (media delle aste di metà e fine mese). - 3) Tasso d'interesse MFI - Monetary
Financial Institutions (pubblicato dalla Banca Centrale Europea) corrisposto dalle imprese finanziarie dell'area euro alle famiglie e alle
imprese non finanziarie sui depositi a termine in essere, con scadenza superiore ai 2 anni.

DEI BUONI ORDINARI DEL TESORO E IL RENDIMENTO
BANCHE, DAL GENNAIO 2006 AL GIUGNO 2016
AND BANK BOND YIELD FROM JANUARY 2006 TO JUNE 2016

TASSO D'INFLAZIONE, RENDIMENTO DEI BUONI ORDINARI DEL TESORO E RENDIMENTO DELLE OBBLIGAZIONI
EMESSE DALLE BANCHE (1) E TASSO D'INTERESSE CORRISPOSTO SUI DEPOSITI BANCARI (2): 2006-2016

