

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 2017, 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 2017. 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 2017 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 2016, controvalore scambiato nell'anno 2016 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 2017. 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 2017 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 2017, 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 2007 al 2016, 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 2017. 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 2007 e il giugno 2017, 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 2017 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 2017. 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 2016, had a trading volume in 2016 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 2017. 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 2017 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 2017. 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 2017. 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 2007 and 30th June 2017.

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 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

(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							
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	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	—	—	—	—	—	—	—
	—	—	—	—	—	—	—
2017							
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							
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	- 0,02	—
	76.194	73.106	3.088	84.079	- 10.973	0,02	—
2016							
1° semestre	40.425	38.981	1.443	31.750	7.231	- 0,13	—
2° semestre	40.425	37.587	2.837	38.981	- 1.394	- 0,25	—
	80.850	76.568	4.280	70.731	5.837	- 0,19	—
2017							
1° semestre	41.525	38.500	3.025	37.587	913	- 0,32	—

BUONI ORDINARI DEL TESORO EMESSI E
ORDINARY TREASURY BILLS ISSUED AND

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

(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							
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	- 0,05	—
2° semestre	39.375	36.850	2.525	39.767	- 2.917	- 0,20	—
	81.225	76.025	5.200	83.173	- 7.148	- 0,13	—
2017							
1° semestre	46.041	40.398	5.643	39.175	1.223	- 0,27	—

	Importo offerto	Importo aggiudicato (a)	Importo non aggiudicato	Importo rimborsato (b)	(a) - (b)	Rendimento annuo lordo	Rendimento annuo netto
B.O.T flessibili							
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	—	—	—	—	—	—	—
2° semestre	—	—	—	—	—	—	—
2017							
1° semestre	—	—	—	—	—	—	—

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

DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017 - RIEPILOGO
BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017 - 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									
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	—	—	—	—
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	—	—	—	—

	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	
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	—
2° semestre	79.800	74.437	5.362	78.748	- 4.311	—	50,50	49,50	—
	162.075	152.593	9.480	153.904	- 1.311	—	—	—	—
2017									
1° semestre	87.566	78.898	8.668	76.762	2.136	—	48,80	51,20	—

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)			
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						
	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						

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.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.....	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	984	6.500	—	6.500
	324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	2.000			
	425435 #	1-VIII-2010	100,30	2,250	4.075			
	425435	1-VIII-2010	100,30	2,250	2.500			
	427349 #	1-II-2018	99,98	2,250	4.000			
Settembre.....	1) 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			
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	2) 16.675	13.925
Dicembre.....	425435	1-VIII-2010	100,30	2,250	2.750	6.050	3) 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.....	4) 122430	1-V-2008	98,70	2,500	-178	11.989	237	11.752
	5) 335798	1-II-2013	100,20	2,375	865			
	6) 387770	15-VI-2008	100,95	1,250	-59			

1) Asta di concambio del 12-IX-2007. - 2) 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. - 3) Di cui Euro 2.666 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. Asta di concambio del 1-XII-2008. - 4) Riacquistato al prezzo di 100,12 con l'asta di concambio del 7-III-2008. - 5) Asta di concambio del 7-III-2008. - 6) Riacquistato al prezzo di 99,61 con l'asta di concambio del 7-III-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.....	428433	15-X-2012	99,85	2,125	3.149	17.320	—	17.320				
	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	550							
	421635	15-IX-2012	100,26	0,925	1.650							
	427349	1-II-2018	99,98	2,250	3.025							
	433252	1-II-2011	100,33	1,875	2.750							
	1) 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							
Maggio.....	436104 #	1-VIII-2018	99,19	2,250	5.000	17.395	22.277	-4.882				
	2) 127336	1-V-2009	100,45	2,250	-282							
	3) 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							
	4) 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	1.650	12.515	—	12.515			
		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	2.000	11.300	27.638	-16.338			
	436555	15-IV-2013	100,00	2,125	2.500							

1) Collocato presso gli investitori da un consorzio di banche al prezzo di 99,135. - 2) Riacquistato con l'asta di concambio del 9-V-2008 al prezzo di 100,45. - 3) Asta di concambio del 9-V-2008. - 4) Collocato presso gli investitori da un consorzio di banche al prezzo di 99,786.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.....	374554	15-IX-2035	99,68	1,175	750	12.074	—	12.074				
	436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	2.750							
	440497	1-IX-2011	99,42	2,125	3.300							
	422062	15-IV-2012	99,40	2,000	1.017							
	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				2.200	12.215	—	12.215
		393465	1-II-2037	101,28	2,000				1.650			
428696		1-VIII-2039	99,98	2,500	1.566							
374554		15-IX-2035	99,68	1,175	1.100							
438054		15-IX-2019	99,78	1,175	376							
440497		1-IX-2011	99,42	2,125	1.570							
Dicembre.....	442395	1-III-2019	94,35	2,250	3.753	13.148	1.255	11.893				
	1) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	2.104							
	2) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050	-794							
	3) 408524	15-VI-2009	100,13	1,875	-461							
	361838	1-VIII-2014	99,20	2,125	1.447							
	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							
Totali.....					157.554	98.804	58.750					
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							
	442395	1-III-2019	94,35	2,250	3.075							

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)				
Febbraio	127851	1-XI-2029	99,70	2,625	956	17.362	16.370	992				
	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							
	408521	15-IX-2017	99,52	1,050	527							
	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							
Aprile	127851	1-XI-2029	99,70	2,625	1.486	22.695	15.259	7.436				
	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							
	446748	1-III-2012	100,22	1,500	3.810							
	448961 #	1-IX-2019	99,20	2,125	6.875							
Maggio	384453	1-VIII-2015	101,79	1,875	1.308	17.312	22.084	-4.772				
	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	5.503	19.706	—	19.706				
	451364 #	1-III-2025	99,01	2,500	5.500							
	424351	15-IX-2023	99,09	1,300	1.308							

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	3.850	15.622	—	15.622
	450897	1-VII-2012	100,15	1,250	3.545			
	450507	1-VI-2014	100,00	1,750	7.476			
	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	996			
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	3.850			
Settembre	450897	1-VII-2012	100,15	1,250	3.300	19.779	—	19.779
	453255 #	1-IX-2040	98,18	2,500	6.000			
	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			
Ottobre	453694 #	1-III-2020	101,92	2,125	6.250	15.459	—	15.459
	450507	1-VI-2014	100,00	1,750	3.000			
	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			
Novembre	450897	1-VII-2012	100,15	1,250	2.565	4.925	23.451	-18.526
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	2.894			
	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	2.000			
	1) 144861	1-XI-2010	100,65	2,750	-72			
	2) 380599	15-IX-2010	99,90	0,475	-486			
Dicembre	3) 387292	15-VI-2010	100,57	1,375	-882	3.563	—	3.563
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	2.925			
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	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			
456463	15-XII-2012	99,47	1,000	3.538				

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)
Febbraio	400967	1-VIII-2021	98,26	1,875	1.901	10.154	—	10.154
	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			
	453694	1-III-2020	101,92	2,125	3.300			
Marzo.....	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.500	24.358	15.450	8.908
	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			
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			

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).

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	539	15.673	17.875	-2.202				
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.111							
	1) 411281	15-IX-2011	100,17	1,875	-419							
	2) 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							
	463413 #	1-III-2021	99,83	1,875	6.250							
Agosto.....	451364	1-III-2025	99,01	2,500	2.596	15.673	17.875	-2.202				
	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							
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.408							
	461217	1-VI-2013	99,02	1,000	3.207							
	463413	1-III-2021	99,83	1,875	3.300							
Ottobre	393465	1-II-2037	101,28	2,000	1.154	15.934	—	15.934				
	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			
3) 41128		15-IX-2011	100,17	1,875	-322							
4) 446748		1-III-2012	100,22	1,500	-575							
5) 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	6) 7) 720	5.880				
	465310	1-XI-2013	99,85	1,125	3.300							
Totali.....						195.608	104.224	91.384				

1) Riacquistato al prezzo di 102,61 con l'asta di concambio del 29-VII-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 2) Riacquistato al prezzo di 102 con l'asta di concambio del 29-VII-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2015 (codice IT0004620305). - 3) Riacquistato al prezzo di 101,63 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 4) Riacquistato al prezzo di 101,25 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 5) Riacquistato al prezzo di 100,4 con l'asta di concambio del 15-XI-2010. Titolo offerto in asta: CCTeu 2010-2017 (codice IT0004652175). - 6) Di cui 220 milioni riacquistati tramite asta a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 7) 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.

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)
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.....	1) 319091	1-II-2012	102,56	2,500	-529	18.119	20.313	-2.194
	2) 422062	15-IV-2012	99,40	2,000	-229			
	3) 427349	1-II-2018	99,98	2,250	2.170			
	4) 446748	1-III-2012	100,22	1,500	-418			
	5) 461217	1-VI-2013	99,02	1,000	-452			
	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.676			
	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	3.500			
	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			
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.....		6) 319091	1-II-2012	102,56	2,500	-836	15.620	1.592
	7) 422062	15-IV-2012	99,40	2,000	-440			
	8) 436104	1-VIII-2018	99,19	2,250	2			
	9) 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		
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			

1) 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). - 2) 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). - 3) Asta di concambio dell'8-II-2011. - 4) 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). - 5) 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). - 6) 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). - 7) Riacquisto 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). - 8) Asta di concambio del 5-IV-2011. - 9) 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 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.....	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							
	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	1) 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							
	3) 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							

1) Di cui euro 652 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 2) Di cui euro 447 milioni riacquistati a valere sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 3) 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). - 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.

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) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	740	10.928	414	10.514
	2) 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			
	463413	1-III-2021	99,83	1,875	1.270			
	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			
Febbraio	465627	1-XI-2015	99,01	1,500	723	15.395	25.807	-10.412
	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			
	480154 #	1-III-2022	100,00	2,750	4.687			
	448961	1-IX-2019	99,20	2,125	1.100			
	480507 #	1-III-2015	99,32	1,250	5.872			
Marzo	480688 #	26-III-2016	100,00	1,225	7.291	20.013	14.871	5.142
	479347	1-V-2017	97,40	2,375	2.500			
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	3.250			
	364476	1-II-2020	99,66	2,250	755			
	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			
Aprile	438054	15-IX-2019	99,78	1,175	990	13.470	15.064	-1.594
	349325	1-II-2019	99,16	2,125	590			
	471274	15-IV-2016	99,79	1,875	541			
	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	1.725			
	484078	15-VII-2015	99,72	2,250	4.216			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.741			
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	1.003			
	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	2.875			

1) Asta di concambio del 7-XII-2011. - 2) 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 IT000324274).

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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	479347	1-V-2017	97,40	2,375	2.666	12.863	—	12.863
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	2.750			
	451364	1-III-2025	99,01	2,500	557			
	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			
Giugno	482042 #	1-VI-2017	96,40	2,375	4.441	14.073	—	14.073
	482143 #	11-VI-2016	100,00	1,775	1.738			
	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			
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	289			
	480154	1-III-2022	100,00	2,750	3.372			
Luglio	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	2.875	7.343	18.065	-10.722
	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			
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	483			
	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	2.875			
Settembre	484883 #	1-XI-2022	98,20	2,750	4.516	9.755	10.438	-683
	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			
	460467	15-IX-2021	99,33	1,050	1.741			
	468210	15-IX-2016	99,50	1,050	1.003			
	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	2.875			
	484883 #	1-XI-2022	98,20	2,750	4.516			

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)				
Ottobre	482042	1-VI-2017	96,40	2,375	3.167	40.998	18.373	22.625				
	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							
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	326							
	484883	1-XI-2022	98,20	2,750	3.394							
	486707 #	1-XI-2017	98,80	1,750	5.144							
	Novembre.....	127851	1-XI-2029	99,70	2,625				763	12.944	—	12.944
		435684	1-VIII-2023	99,13	2,375				938			
484078		15-VII-2015	99,72	2,250	3.955							
438054		15-IX-2019	99,78	1,175	859							
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							
Dicembre	464473	1-IX-2026	100,07	2,250	841	5.385	18.685	-13.300				
	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							
	486707	1-XI-2017	98,80	1,750	3.000							
Febbraio	453255	1-IX-2040	98,18	2,500	1.020	15.309	21.008	-5.699				
	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							
	486707	1-XI-2017	98,80	1,750	2.875							
	489803 #	1-V-2023	97,81	2,250	5.200							

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.....	488099	1-XII-2015	100,75	1,375	3.848	14.455	1) ²⁾ 1.845	12.610
	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			
	489803	1-V-2023	97,81	2,250	3.095			
	490784 #	1-VI-2018	99,44	1,750	4.513			
	Aprile.....	488903	1-IX-2028	100,01	2,375			
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			
490784		1-VI-2018	99,44	1,750	3.450			
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			
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			
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			

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.

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	495341	1-VIII-2024	100,77	2,250	3.000	17.362	—	17.362
	495757	1-XII-2018	100,71	1,750	3.000			
	496640 #	1-V-2021	100,13	1,875	5.000			
	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			
	5) 495757	1-XII-2018	100,71	1,750	3.310			
	495341	1-VIII-2024	100,77	2,250	2.875			
Dicembre	495341	1-VIII-2024	100,77	2,250	2.875	6.325	9) 7) 8) 22.917	-16.592
	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			
496640		1-V-2021	100,13	1,875	2.875			
498719		15-XII-2016	100,00	0,750	4.025			
9) 371991		1-II-2015	100,43	2,125	-373			
10) 461591		15-VI-2015	100,50	1,500	-466			
11) 490784		1-VI-2018	99,44	1,750	2.500			
12) 384453		1-VIII-2015	101,79	1,875	-686			

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). - 5) Asta di concambio del 18-XI-2013. - 6) Di cui Euro 303 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 7) Di cui Euro 1.190 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 8) Di cui Euro 1.418 milioni in riacquisti sul mercato, a valere sul Conto Disponibilità. - 9) Riacquistato 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). - 10) Riacquistato 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). - 11) Asta di concambio del 17-II-2014. - 12) Riacquistato 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 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.....	489088	15-IX-2018	99,50	0,850	1.150	19.709	—	19.709
	499230	1-V-2019	100,40	1,250	3.186			
	500154 #	1-IX-2024	103,11	1,875	4.250			
	500442 #	15-IX-2024	99,75	1,175	4.500			
	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			
Aprile.....	498719	15-XII-2016	100,00	0,750	3.608	16.745	14.797	1.948
	499230	1-V-2019	100,40	1,250	3.000			
	500154	1-IX-2024	103,11	1,875	3.750			
	498719	15-XII-2016	100,00	0,750	3.564			
	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			
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			
Giugno.....	3) 488099	1-XII-2015	100,75	1,375	-464	21.134	20.643	491
	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			
	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	1.150			
	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			

1) Riacquistato 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) Riacquistato 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) Riacquistato 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) Riacquistato 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) Riacquistato 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) Riacquistato 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) Riacquistato al prezzo di 104,232 con l'asta di concambio del 20-VI-2014. Titolo offerto in asta: BTP 2011-2022 5% (codice IT0004759673).

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)
Luglio	500154	1-IX-2024	103,11	1,875	2.875	15.274	1) 13.890	1.384
	503050 #	1-VIII-2019	100,74	0,750	4.768			
	502345	15-V-2017	100,25	0,575	3.450			
	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			
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	14.772	14.500	272
Settembre	502345	15-V-2017	100,25	0,575	2.457			
	502423	1-III-2030	99,47	1,750	2.000			
	502800	15-XII-2021	100,27	1,075	2.500			
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	524			
	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			
Ottobre	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	1.437	22.557	1.004	21.553
	502800	15-XII-2021	100,27	1,075	2.300	12.301	4) 14.491	-2.190
	505846 #	15-I-2018	100,00	0,375	4.128			
	2) 384453	1-VIII-2015	101,79	1,875	-702			
	3) 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			
	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	200.652	112.491	88.161
	506939	1-XII-2019	100,53	0,525	3.295			

1) Di cui Euro 393 milioni riacquistati a valore sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 2) 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). - 3) 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). - 4) Di cui Euro 3,671 miliardi riacquistati a valore sul Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 5) Di cui Euro 907 milioni in riacquisti sul mercato, a valore sul Conto Disponibilità. - 6) Di cui Euro 1.079 milioni in riacquisti sul mercato, a valore sul Conto Disponibilità. - 7) Di cui Euro 812 milioni in riacquisti sul mercato, a valore sul Conto Disponibilità.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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)
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			
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			
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			
Maggio	509031	1-VI-2025	101,40	0,750	2.000	16.206	—	16.206
	510770 #	1-V-2020	100,33	0,350	4.137			
	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	750			
	508688	15-IV-2022	100,80	0,675	2.500			

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.

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.....	509408	1-III-2032	99,50	0,825	749	12.731	16.927	-4.196				
	510604	15-V-2018	100,07	0,125	3.087							
	¹⁾ 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							
	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	946							
	508688	15-IV-2022	100,80	0,675	2.300							
	509408	1-III-2032	99,50	0,825	778							
Luglio.....	510604	15-V-2018	100,07	0,125	2.502	14.345	17.005	-2.660				
	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							
	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	1.599							
	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							
	²⁾ 401958	1-VIII-2016	100,36	1,875	-345							
Agosto.....	³⁾ 482042	1-VI-2017	96,40	2,375	-222	6.670	23.968	-17.298				
	⁴⁾ 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							
	510770	1-V-2020	100,33	0,350	2.196							
	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			
⁵⁾ 498719		15-XII-2016	100,00	0,750	-440							
⁶⁾ 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							

¹⁾ Asta di concambio del 21-VII-2015. - ²⁾ 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). - ³⁾ 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). - ⁴⁾ Riacquistato al prezzo di 107,385 con l'asta di concambio del 17-VII-2015. Titolo offerto in asta BTP 2014-2020 (codice IT0005024234). - ⁵⁾ Riacquistato al prezzo di 101,76 con l'asta di concambio del 16-IX-2015. Titolo offerto in asta CCT 2014-2020 (codice IT0005056541). - ⁶⁾ Riacquistato al prezzo di 101,69 con l'asta di concambio del 16-IX-2015. Titolo offerto in asta CCT 2014-2020 (codice IT0005056541).

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.....	513882 #	15-IX-2032	99,77	0,625	3.500	17.396	¹⁾ 3.947	13.449
	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			
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			
Febbraio.....	514214	1-XI-2020	100,57	0,325	2.587	23.997	—	23.997
	516282 #	1-III-2047	99,18	1,350	9.000			
	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			

¹⁾ Di cui Euro 3,9 miliardi di rimborsi a scadenza mediante utilizzo del 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)				
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	2,25	-363							
	4) 479347	1-V-2017	97,40	2,375	-538							
	5) 488903	1-IX-2028	100,01	2,375	1.627							
	509408	1-III-2032	99,5	0,825	1.725							
	513909	15-X-2018	100,15	0,15	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	6) 28.570	16.235	12.335
		502423	1-III-2030	99,47	1,750				706			
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.....		7) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	-370	18.183	15.511	2.672			
	8) 353515	1-VIII-2034	98,10	2,500	1.910							
	9) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050	-205							
	10) 486707	1-XI-2017	98,80	1,750	-455							
	11) 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							
	Giugno.....	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							
12) 324274		1-VIII-2017	98,34	2,625	-270							
13) 427349		1-II-2018	99,98	2,250	-732							
14) 489803		1-V-2023	97,81	2,25	2.000							

1) Riacquisito 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) Riacquisito 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) Riacquisito 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) Riacquisito 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. - 6) Di cui Euro 3,7 miliardi di rimborsi a scadenza mediante utilizzo del Fondo per l'ammortamento dei titoli di Stato. - 7) Riacquisito al prezzo di 106,54 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 8) Asta di concambio del 6-V-2016. - 9) Riacquisito al prezzo di 104,485 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 10) Riacquisito al prezzo di 105,249 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 11) Riacquisito al prezzo di 101,258 con l'asta di concambio del 6-V-2016. Titolo offerto in asta BTP 5% 2003-2034 (codice IT0003535157). - 12) Riacquisito 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). - 13) Riacquisito 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). - 14) Asta di concambio del 17-VI-2016.

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.....	1) 490784	1-VI-2018	99,44	1,750	-562	16.873	—	16.873
	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			
	509408	1-III-2032	99,50	0,825	1.251			
	517232	15-III-2023	101,07	0,475	2.503			
	517727	15-IV-2019	100,15	0,050	2.069			
	517790	1-IX-2036	99,36	1,125	1.750			
	518812	15-V-2022	99,82	0,050	1.150			
	517559	1-VI-2021	100,55	0,225	2.300			
Agosto.....	521065 #	1-XII-2026	100,18	0,625	5.850	6.595	25.929	-19.334
	517559	1-VI-2021	100,55	0,225	3.231			
Settembre.....	2) 427349	1-II-2018	99,98	2,250	-734	17.815	27.092	-9.277
	3) 482042	1-VI-2017	96,40	2,375	-607			
	4) 488903	1-IX-2028	100,01	2,375	2.000			
	5) 510604	15-V-2018	100,07	0,125	-639			
	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	750			
	517727	15-IV-2019	100,15	0,050	2.000			
	517790	1-IX-2036	99,36	1,125	1.250			
	521524 #	15-IX-2023	99,70	0,325	4.000			
	513882	15-IX-2032	99,77	0,625	939			
	521065	1-XII-2026	100,18	0,625	2.875			
Ottobre.....	521649 #	1-XI-2021	100,33	0,175	4.001	20.319	18.017	2.302
	521739 #	1-III-2067	99,19	1,400	5.000			
	509408	1-III-2032	99,50	0,825	2.064			
	521524	15-IX-2023	99,70	0,325	2.506			
	521792 #	15-X-2019	100,05	0,025	4.000			
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	831			
	500442	15-IX-2024	99,75	1,175	668			
	521065	1-XII-2026	100,18	0,625	2.500			
	521649	1-XI-2021	100,33	0,175	2.750			
	Novembre.....	325682	1-II-2033	101,15	2,875			
6) 427349		1-II-2018	99,98	2,250	-386			
7) 436104		1-VIII-2018	99,19	2,250	-248			
8) 486707		1-XI-2017	98,80	1,750	-530			
453255		1-IX-2040	98,18	2,500	604			
516282		1-III-2047	99,18	1,350	1.312			

1) Riacquisito 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). - 2) Riacquisito al prezzo di 106,511 con l'asta di concambio del 7-IX-2016. Titolo offerto in asta BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 3) Riacquisito al prezzo di 103,659 con l'asta di concambio del 7-IX-2016. Titolo offerto in asta BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 4) Asta di concambio del 7-IX-2016. - 5) Riacquisito al prezzo di 100,645 con l'asta di concambio del 7-IX-2016. Titolo offerto in asta BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 6) Riacquisito al prezzo di 105,630 con l'asta di concambio del 4-XI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2033 5,75% (codice IT0003256820). - 7) Riacquisito al prezzo di 107,710 con l'asta di concambio del 4-XI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2033 5,75% (codice IT0003256820). - 8) Riacquisito al prezzo di 103,610 con l'asta di concambio del 4-XI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2033 5,75% (codice IT0003256820).

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)
	521524	15-IX-2023	99,70	0,325	2.250			
	521792	15-X-2019	100,05	0,025	2.750			
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	414			
	518812	15-V-2022	99,82	0,050	791			
	521065	1-XII-2026	100,18	0,625	1.725			
	521649	1-XI-2021	100,33	0,175	2.012			
Dicembre	108656	1-XI-2026	99,45	3,625	1.005	5.230	15.564	-10.334
	521065	1-XII-2026	100,18	0,625	1.725			
	521649	1-XI-2021	100,33	0,175	2.500			
Totali						199.921	144.135	55.786
2017								
Gennaio	517790	1-IX-2036	99,36	1,125	1.500	22.718	—	22.718
	521524	15-IX-2023	99,70	0,325	2.750			
	521792	15-X-2019	100,05	0,025	3.001			
	524035 #	1-IX-2033	99,13	1,225	6.000			
	513882	15-IX-2032	99,77	0,625	1.105			
	521649	1-XI-2021	100,33	0,175	3.162			
	524083 #	1-VI-2027	98,58	1,100	5.200			
Febbraio	428696	1-VIII-2039	99,98	2,500	1.183	19.899	24.397	-4.498
	510770	1-V-2020	100,33	0,350	1.150			
	516282	1-III-2047	99,18	1,350	1.516			
	521524	15-IX-2023	99,70	0,325	2.875			
	521792	15-X-2019	100,05	0,025	3.162			
	473515	15-IX-2026	100,00	1,550	536			
	518812	15-V-2022	99,82	0,050	827			
	517083	1-VI-2026	100,97	0,800	1.150			
	524083	1-VI-2027	98,58	1,100	2.300			
	524478 #	1-IV-2022	100,46	0,600	5.200			
Marzo	524613 #	15-V-2028	99,87	0,650	3.000	20.066	1.658	18.408
	508305	1-IX-2046	99,70	1,625	1.562			
	521792	15-X-2019	100,05	0,025	2.750			
	524035	1-IX-2033	99,13	1,225	1.386			
	524634 #	15-V-2024	99,71	0,925	3.500			
	1) 324274	1-VIII-2017	98,34	2,625	-159			

1) Riacquistato al prezzo di 102,055 con l'asta di concambio del 17-III-2017. Titolo offerto in asta: BTP 2003-2034 5% (codice IT0003535157). - 2) Asta di concambio del 17-III-2017. - 3) Riacquistato al prezzo di 102 con l'asta di concambio del 17-III-2017. Titolo offerto in asta: BTP 2003-2034 5% (codice IT0003535157).

RIMBORSATI DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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)
	2) 353515	1-VIII-2034	98,10	2,500	1.368			
	3) 408521	15-IX-2017	99,52	1,050	-75			
	1) 427349	1-II-2018	99,98	2,250	-717			
	2) 486707	1-XI-2017	98,80	1,750	-275			
	3) 505846	15-I-2018	100,00	0,375	-429			
	514214	1-XI-2020	100,57	0,325	1.000			
	521739	1-III-2067	99,19	1,400	750			
	524083	1-VI-2027	98,58	1,100	2.500			
	524478	1-IV-2022	100,46	0,600	2.250			
Aprile	502423	1-III-2030	99,47	1,75	1.200	19.611	17.056	2.555
	517790	1-IX-2036	99,36	1,125	2.400			
	524634	15-V-2024	99,71	0,925	2.875			
	525094 #	15-VI-2020	99,64	0,175	5.850			
	513882	15-IX-2032	99,77	0,625	512			
	518812	15-V-2022	99,82	0,05	737			
	524083	1-VI-2027	98,58	1,100	3.162			
	524478	1-IV-2022	100,46	0,600	2.875			
Maggio	492399	1-IX-2044	97,22	2,375	1.499	24.949	35.242	-10.293
	516282	1-III-2047	99,18	1,350	1.250			
	524634	15-V-2024	99,71	0,925	2.587			
	525094	15-VI-2020	99,64	0,175	2.819			
	525367 #	22-V-2023	100,00	0,225	8.589			
	4) 117461	1-XI-2027	100,15	3,250	750			
	5) 364476	1-II-2020	99,66	2,250	750			
	6) 451364	1-III-2025	99,01	2,500	850			
	7) 496920	12-XI-2017	100,00	1,075	-8.849			
	8) 509408	1-III-2032	99,50	0,825	950			
	454589	15-IX-2041	98,89	1,275	472			
	524613	15-V-2028	99,87	0,650	983			
	524478	1-IV-2022	100,46	0,600	3.450			
Giugno	527301 #	1-III-2048	98,95	1,725	6.500	21.745	14.979	6.766
	524634	15-V-2024	99,71	0,925	3.450			
	525094	15-VI-2020	99,64	0,175	2.875			
	473515	15-IX-2026	100,00	1,55	461			
	518812	15-V-2022	99,82	0,050	538			
	524478	1-IV-2022	100,46	0,60	2.875			
	527480 #	1-VIII-2027	99,080	1,025	5.046			
Totali						128.988	93.332	35.656

1) Riacquistato al prezzo di 104,085 con l'asta di concambio del 17-III-2017. Titolo offerto in asta: BTP 2003-2034 5% (codice IT0003535157). - 2) Riacquistato al prezzo di 102,311 con l'asta di concambio del 17-III-2017. Titolo offerto in asta: BTP 2003-2034 5% (codice IT0003535157). - 3) Riacquistato al prezzo di 100,795 con l'asta di concambio del 17-III-2017. Titolo offerto in asta: BTP 2003-2034 5% (codice IT0003535157). - 4) Asta di concambio del 25-V-2017. - 5) Asta di concambio del 25-V-2017. - 6) Asta di concambio del 25-V-2017. - 7) Riacquistato al prezzo di 101,74 con l'asta di concambio del 25-V-2017. Titoli offerti in asta: BTP 2004-2020 4,5% (codice IT0003644769), BTP 2009-2025 5% (codice IT0004513641), BTP 1997-2027 6,5% (codice IT0001174611). - 8) Asta di concambio del 25-V-2017.

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)
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			
	424480	CTZ 30-VI-2009	91,72	—	2.000	3.650	—	3.650
422404	CCT 1-III-2014	101,04	0,15	1.650				
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.

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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			
Aprile	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.375	4.875	9.592	- 4.717
	436105 #	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	3.500			
Maggio	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	1.375	3.260	17.245	- 13.985
	4) 321971	CCT 1-VII-2009	100,78	0,15	- 298			
	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			
Giugno	436105	CTZ 31-XII-2009	92,28	—	2.750	3.261	—	3.261
	432181	CCT 1-XII-2014	100,70	0,15	511			
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.

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)
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.

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.

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)
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			
	466235 #	CTZ 31-XII-2012	100,00	—	245			
	465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	1.339			
Dicembre.....	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).

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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).

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)
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
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
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.

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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.

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)
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).

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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 3,5% (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).

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)
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			
Luglio	517536	CTZ 28-III-2018	100,12	—	2.875	5.175	13.380	- 8.205
	518545	CCT 15-VII-2023	100,38	—	2.300			
Agosto	518545	CCT 15-VII-2023	100,38	—	1.846	1.846	13.827	- 11.981

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).

DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017
REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017

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) 492290	CCT 1-XI-2018	98,4	—	- 227	4.800	703	4.097
	2) 512698	CTZ 30-VIII-2017	99,66	—	- 476			
	517536	CTZ 28-III-2018	100,12	—	2.500			
	518545	CCT 15-VII-2023	100,38	—	2.300			
Ottobre	521896 #	CCT 15-II-2024	99,8	—	3.250	3.250	—	3.250
Novembre	3) 465217	CCT 15-X-2017	99,78	—	- 338	7.949	999	6.950
	4) 508995	CTZ 27-II-2017	99,56	—	- 660			
	522128 #	CTZ 28-XII-2018	99,41	—	4.550			
	510447	CCT 15-VI-2022	100,13	—	1.150			
	521896	CCT 15-II-2024	99,8	—	2.249			
Dicembre	521896	CCT 15-II-2024	99,8	—	2.012	2.012	14	1.998
Totali						46.579	40.773	5.806
2017								
Gennaio	522128	CTZ 28-XII-2018	99,41	—	2.500	5.087	—	5.087
	521896	CCT 15-II-2024	99,8	—	2.587			
Febbraio	522128	CTZ 28-XII-2018	99,41	—	2.875	6.324	11.383	- 5.059
	513761	CCT 15-XII-2022	99,93	—	1.254			
	521896 #	CCT 15-II-2024	99,8	—	2.195			
Marzo	522128	CTZ 28-XII-2018	99,41	—	2.875	5.535	16.732	- 11.197
	521896	CCT 15-II-2024	99,8	—	2.660			
Aprile	522128	CTZ 28-XII-2018	99,41	—	2.300	6.850	—	6.850
	525252 #	CCT 31-X-2024	99,5	—	4.550			
Maggio	5) 518545	CCT 15-VII-2023	100,38	—	900	6.466	—	6.466
	525647 #	CTZ 30-V-2019	100,15	—	3.554			
	525252	CCT 31-X-2024	99,5	—	2.012			
Giugno	525647	CTZ 30-V-2019	100,15	—	2.500	4.225	—	4.225
	525252	CCT 31-X-2024	99,5	—	1.725			
Totali						34.487	28.115	6.372

1) Riacquistato al prezzo di 103,665 con l'asta di concambio del 7-IX-2016. Titolo offerto in asta BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 2) Riacquistato al prezzo di 100,232 con l'asta di concambio del 7-IX-2016. Titolo offerto in asta BTP 2013-2028 4,75% (codice IT0004889033). - 3) Riacquistato al prezzo di 100,753 con l'asta di concambio del 4-XI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2033 5,75% (codice IT0003256820). - 4) Riacquistato al prezzo di 100,093 con l'asta di concambio del 4-XI-2016. Titolo offerto in asta: BTP 2002-2033 5,75% (codice IT0003256820). - 5) Asta di concambio del 25-V-2017.

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

RIMBORSATI DAL TESORO DAL 1° GENNAIO 2007 AL 30 GIUGNO 2017 - RIEPILOGO
ISSUED AND REDEEMED BETWEEN 1st JANUARY 2007 AND 30th JUNE 2017 - 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
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
	133.223	49.241	182.464	101.023	49.349	150.374
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
	157.554	48.947	206.501	98.806	55.177	153.983
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
	184.842	65.983	250.825	94.108	69.430	163.539
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
	195.608	73.084	268.692	104.227	71.266	175.494
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
	164.377	48.686	213.063	94.514	67.426	161.941
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
	180.010	46.984	226.994	121.305	72.548	193.854

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
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
	208.906	57.440	266.346	124.459	40.459	164.918
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
	200.652	53.303	253.955	112.492	86.662	199.154
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
	189.424	53.724	243.148	142.719	56.236	198.955
2016						
1° semestre	119.731	21.547	141.278	43.967	11.851	55.818
2° semestre	80.190	25.032	105.222	100.171	28.925	129.096
	199.921	46.579	246.500	144.138	40.776	184.914
2017						
1° semestre	128.988	34.487	163.475	93.333	28.115	121.448

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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													
IT0005239030	BOT 12-I-2018	—	2017	—	12-I-2018	—	12-I	7.700.000	25.793	7.700.000	1000	100,25	—
IT0005248395	BOT 13-IV-2018	—	2017	—	13-IV-2018	—	13-IV	6.000.000	3.804	6.000.000	1000	100,24	—
IT0005216921	BOT 13-X-2017	—	2016	—	13-X-2017	—	13-X	6.250.000	13.172	6.250.000	1000	100,24	—
IT0005241770	BOT 14-II-2018	—	2017	—	14-II-2018	—	14-II	6.548.328	15.590	6.548.328	1000	100,25	—
IT0005245326	BOT 14-III-2018	—	2017	—	14-III-2018	—	14-III	6.500.000	17.756	6.500.000	1000	100,23	—
IT0005214843	BOT 14-IX-2017	—	2016	—	14-IX-2017	—	14-IX	6.750.000	16.437	6.750.000	1000	100,18	—
IT0005253106	BOT 14-V-2018	—	2017	—	14-V-2018	—	14-V	7.150.000	4.835	7.150.000	1000	100,31	—
IT0005260010	BOT 14-VI-2018	—	2017	—	14-VI-2018	—	14-VI	6.500.000	3.058	6.500.000	1000	100,36	—
IT0005203523	BOT 14-VII-2017	—	2016	—	14-VII-2017	—	14-VII	6.500.000	62.743	6.500.000	1000	100,18	—
IT0005211138	BOT 14-VIII-2017	—	2016	—	14-VIII-2017	—	14-VIII	6.600.000	39.193	6.600.000	1000	100,19	—
IT0005219404	BOT 14-XI-2017	—	2016	—	14-XI-2017	—	14-XI	6.000.000	8.550	6.000.000	1000	100,22	—
IT0005222135	BOT 14-XII-2017	—	2016	—	14-XII-2017	—	14-XII	4.750.000	22.469	4.750.000	1000	100,20	—
IT0005245359	BOT 29-IX-2017	—	2017	—	29-IX-2017	—	29-IX	6.500.000	2.408	6.500.000	1000	100,15	—
IT0005253114	BOT 30-XI-2017	—	2017	—	30-XI-2017	—	30-XI	6.000.000	657	6.000.000	1000	100,18	—
IT0005239022	BOT 31-VII-2017	—	2017	—	31-VII-2017	—	31-VII	6.500.000	9.985	6.500.000	1000	100,14	—
IT0005241788	BOT 31-VIII-2017	—	2017	—	31-VIII-2017	—	31-VIII	6.150.000	36.518	6.150.000	1000	100,15	—
IT0005248403	BOT 31-X-2017	—	2017	—	31-X-2017	—	31-X	6.600.000	2.624	6.600.000	1000	100,17	—
IT0000366655	BTP 1993-2023 9%	9,00	1993	—	01-XI-2023	01-V; 01-XI	01-XI	11.226.155	742.270	11.226.155	0,01	93,75	—
IT0001086567	BTP 1996-2026 7,25%	7,25	1996	—	01-XI-2026	01-V; 01-XI	01-XI	10.423.130	514.684	10.423.130	0,01	99,45	—
IT0001174611	BTP 1997-2027 6,5%	6,50	1997	—	01-XI-2027	01-V; 01-XI	01-XI	26.763.132	673.904	26.763.132	0,01	100,15	—
IT0001278511	BTP 1998-2029 5,25%	5,25	1998	—	01-XI-2029	01-V; 01-XI	01-XI	28.148.499	1.002.392	29.762.750	0,01	99,70	—
IT0001444378	BTP 2000-2031 6%	6,00	1999	—	01-V-2031	01-V; 01-XI	01-V	29.762.750	457.349	29.762.750	1000	102,40	—
IT0003242747	BTP 2002-2017 5,25%	5,25	2002	—	01-VIII-2017	01-II; 01-VIII	01-VIII	22.089.549	243.045	24.300.000	1000	98,35	—
IT0003256820	BTP 2002-2033 5,75%	5,75	2002	—	01-II-2033	01-II; 01-VIII	01-II	16.954.000	498.356	16.954.000	1000	101,15	—
IT0003493258	BTP 2003-2019 4,25%	4,25	2003	—	01-II-2019	01-II; 01-VIII	01-II	24.629.574	358.523	24.629.574	1000	99,16	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0003535157	BTP 2003-2034 5%	5,00	2003	—	01-VIII-2034	01-II; 01-VIII	01-VIII	25.110.921	904.763	25.110.921	1000	98,11	—
IT0003644769	BTP 2004-2020 4,5%	4,50	2004	—	01-II-2020	01-II; 01-VIII	01-II	23.409.650	423.379	23.409.650	1000	99,67	—
IT0003934657	BTP 2005-2037 4%	4,00	2005	—	01-II-2037	01-II; 01-VIII	01-II	26.291.398	4.482.642	26.291.398	1000	101,29	—
IT0004009673	BTP 2006-2021 3,75%	3,75	2006	—	01-VIII-2021	01-II; 01-VIII	01-VIII	26.628.325	1.168.701	26.628.325	1000	98,26	—
IT0004273493	BTP 2007-2018 4,5%	4,50	2007	—	01-II-2018	01-II; 01-VIII	01-II	21.871.466	333.050	24.806.256	1000	99,98	—
IT0004286966	BTP 2007-2039 5%	5,00	2007	—	01-VIII-2039	01-II; 01-VIII	01-VIII	20.520.265	729.364	20.520.265	1000	99,98	—
IT0004361041	BTP 2008-2018 4,5%	4,50	2008	—	01-VIII-2018	01-II; 01-VIII	01-VIII	25.251.174	469.354	25.499.297	1000	99,19	—
IT0004423957	BTP 2008-2019 4,5%	4,50	2008	—	01-III-2019	01-III; 01-IX	01-III	22.644.728	200.922	22.644.728	1000	94,35	—
IT0004356843	BTP 2008-2023 4,75%	4,75	2008	—	01-VIII-2023	01-II; 01-VIII	01-VIII	24.799.152	933.348	24.799.152	1000	99,14	—
IT0004489610	BTP 2009-2019 4,25%	4,25	2009	—	01-IX-2019	01-III; 01-IX	01-IX	25.012.075	405.321	25.012.075	1000	99,20	—
IT0004536949	BTP 2009-2020 4,25%	4,25	2009	—	01-III-2020	01-III; 01-IX	01-III	24.330.808	644.489	24.330.808	1000	101,92	—
IT0004513641	BTP 2009-2025 5%	5,00	2009	—	01-III-2025	01-III; 01-IX	01-III	24.718.669	1.027.521	24.718.669	1000	99,01	—
IT0004532559	BTP 2009-2040 5%	5,00	2009	—	01-IX-2040	01-III; 01-IX	01-IX	22.152.355	1.863.688	22.152.355	1000	98,19	—
IT0004594930	BTP 2010-2020 4%	4,00	2010	—	01-IX-2020	01-III; 01-IX	01-IX	24.922.124	664.229	24.922.124	1000	100,70	—
IT0004634132	BTP 2010-2021 3,75%	3,75	2010	—	01-III-2021	01-III; 01-IX	01-III	24.268.782	1.010.268	24.268.782	1000	99,83	—
IT0004644735	BTP 2010-2026 4,5%	4,50	2010	—	01-IX-2026	01-III; 01-IX	01-IX	20.733.398	1.777.290	20.733.398	1000	100,07	—
IT0004695075	BTP 2011-2021 4,75%	4,75	2011	—	01-III-2021	01-III; 01-IX	01-III	24.986.368	949.551	24.986.368	1000	99,73	—
IT0004759673	BTP 2011-2022 5%	5,00	2011	—	01-III-2022	01-III; 01-IX	01-III	20.635.579	942.642	20.635.579	1000	98,75	—
IT0004867070	BTP 2012-2017 3,5%	3,50	2012	—	01-XI-2017	01-V; 01-XI	01-XI	15.702.674	276.483	17.341.203	1000	98,80	—
IT0004801541	BTP 2012-2022 5,5%	5,50	2012	—	01-III-2022	01-III; 01-IX	01-III	19.586.032	503.580	19.586.032	1000	100,58	—
IT0004848831	BTP 2012-2022 5,5%	5,50	2012	—	01-XI-2022	01-V; 01-XI	01-XI	21.378.388	617.839	21.378.388	1000	98,20	—
IT0004907843	BTP 2013-2018 3,5%	3,50	2013	—	01-VI-2018	01-VI; 01-XII	01-VI	19.388.580	490.630	19.950.805	1000	99,44	—
IT0004957574	BTP 2013-2018 3,5%	3,50	2013	—	01-XII-2018	01-VI; 01-XII	01-XII	19.858.640	390.943	19.858.640	1000	100,71	—
IT0004966401	BTP 2013-2021 3,75%	3,75	2013	—	01-V-2021	01-V; 01-XI	01-V	18.397.553	975.597	18.397.553	1000	100,14	—
IT0004898034	BTP 2013-2023 4,5%	4,50	2013	—	01-V-2023	01-V; 01-XI	01-V	20.070.594	694.118	20.070.594	1000	97,81	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0004953417	BTP 2013-2024 4,5%	4,50	2013	—	01-VIII-2024	01-II; 01-VIII	01-VIII	23.264.571	767.390	23.264.571	1000	100,77	—
IT0004889033	BTP 2013-2028 4,75%	4,75	2013	—	01-IX-2028	01-III; 01-IX	01-IX	21.783.564	988.786	21.783.564	1000	100,02	—
IT0004923998	BTP 2013-2044 4,75%	4,75	2013	—	01-IX-2044	01-III; 01-IX	01-IX	17.119.363	1.567.175	17.119.363	1000	97,22	—
IT0005058463	BTP 2014-2018 0,75%	0,75	2014	—	15-I-2018	15-I; 15-VII	15-I	15.304.665	348.857	15.733.746	1000	100,17	—
IT0005069395	BTP 2014-2019 1,05%	1,05	2014	—	01-XII-2019	01-VI; 01-XII	01-XII	15.470.969	581.995	15.470.969	1000	100,53	—
IT0005030504	BTP 2014-2019 1,5%	1,50	2014	—	01-VIII-2019	01-II; 01-VIII	01-VIII	16.393.156	407.814	16.393.156	1000	100,74	—
IT0004992308	BTP 2014-2019 2,5%	2,50	2014	—	01-V-2019	01-V; 01-XI	01-V	18.316.158	288.035	18.316.158	1000	100,40	—
IT0005028003	BTP 2014-2021 2,15%	2,15	2014	—	15-XII-2021	15-VI; 15-XII	15-XII	17.657.877	1.142.576	17.657.877	1000	100,27	—
IT0005045270	BTP 2014-2024 2,5%	2,50	2014	—	01-XII-2024	01-VI; 01-XII	01-XII	20.383.767	898.953	20.383.767	1000	101,14	—
IT0005001547	BTP 2014-2024 3,75%	3,75	2014	—	01-IX-2024	01-III; 01-IX	01-IX	19.826.000	743.301	19.826.000	1000	103,10	—
IT0005024234	BTP 2014-2030 3,5%	3,50	2014	—	01-III-2030	01-III; 01-IX	01-III	23.156.449	1.633.946	23.156.449	1000	99,47	—
IT0005083057	BTP 2014-2046 3,25%	3,25	2014	—	01-IX-2046	01-III; 01-IX	01-IX	15.552.825	6.087.159	15.552.825	1000	99,71	—
IT0005106049	BTP 2015-2018 0,25%	0,25	2015	—	15-V-2018	15-V; 15-XI	15-V	13.607.659	491.852	14.247.338	1000	100,07	—
IT0005139099	BTP 2015-2018 0,3%	0,30	2015	—	15-X-2018	15-IV; 15-X	15-X	12.199.233	515.406	12.199.233	1000	100,15	—
IT0005142143	BTP 2015-2020 0,65%	0,65	2015	—	01-XI-2020	01-V; 01-XI	01-XI	15.068.700	1.208.255	15.068.700	1000	100,57	—
IT0005107708	BTP 2015-2020 0,7%	0,70	2015	—	01-V-2020	01-V; 01-XI	01-V	16.458.150	620.201	16.458.150	1000	100,33	—
IT0005086886	BTP 2015-2022 1,35%	1,35	2015	—	15-IV-2022	15-IV; 15-X	15-IV	17.784.500	1.220.368	17.784.500	1000	100,80	—
IT0005135840	BTP 2015-2022 1,45%	1,45	2015	—	15-IX-2022	15-III; 15-IX	15-IX	17.005.194	899.427	17.005.194	1000	100,54	—
IT0005090318	BTP 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	01-VI-2025	01-VI; 01-XII	01-VI	19.786.723	2.064.631	19.786.723	1000	101,40	—
IT0005127086	BTP 2015-2025 2%	2,00	2015	—	01-XII-2025	01-VI; 01-XII	01-XII	17.829.296	2.179.002	17.829.296	1000	100,51	—
IT0005094088	BTP 2015-2032 1,65%	1,65	2015	—	01-III-2032	01-III; 01-IX	01-III	21.806.727	8.929.836	21.806.727	1000	99,50	—
IT0005217929	BTP 2016-2019 0,05%	0,05	2016	—	15-X-2019	15-IV; 15-X	15-X	15.663.500	830.748	15.663.500	1000	100,05	—
IT0005177271	BTP 2016-2019 0,10%	0,10	2016	—	15-IV-2019	15-IV; 15-X	15-IV	12.117.336	499.528	12.117.336	1000	100,15	—
IT0005216491	BTP 2016-2021 0,35%	0,35	2016	—	01-XI-2021	01-V; 01-XI	01-XI	14.426.000	2.375.842	14.426.000	1000	100,33	—
IT0005175598	BTP 2016-2021 0,45%	0,45	2016	—	01-VI-2021	01-VI; 01-XII	01-VI	17.414.767	2.037.416	17.414.767	1000	100,55	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0005215246	BTP 2016-2023 0,65%	0,65	2016	—	15-X-2022	15-IV; 15-X	15-X	14.381.000	2.134.599	14.381.000	1000	99,70	—
IT0005172322	BTP 2016-2023 0,95%	0,95	2016	—	15-III-2023	15-III; 15-IX	15-III	16.247.343	1.597.225	16.247.343	1000	101,07	—
IT0005210650	BTP 2016-2026 1,25%	1,25	2016	—	01-XII-2026	01-VI; 01-XII	01-XII	18.039.664	6.911.966	18.039.664	1000	100,18	—
IT0005170839	BTP 2016-2026 1,6%	1,60	2016	—	01-VI-2026	01-VI; 01-XII	01-VI	17.774.500	3.200.236	17.774.500	1000	100,97	—
IT0005240350	BTP 2016-2033 2,45%	2,45	2016	—	01-IX-2033	01-III; 01-IX	01-IX	7.386.500	1.891.901	7.386.500	1000	99,13	—
IT0005177909	BTP 2016-2036 2,25%	2,25	2016	—	01-IX-2036	01-III; 01-IX	01-IX	13.400.000	4.443.017	13.400.000	1000	99,37	—
IT0005162828	BTP 2016-2047 2,7%	2,70	2016	—	01-III-2047	01-III; 01-IX	01-III	15.711.894	12.471.233	15.711.894	1000	99,18	—
IT0005217390	BTP 2016-2067 2,8%	2,80	2016	—	01-IX-2066	01-III; 01-IX	01-IX	5.750.000	11.257.948	5.750.000	1000	99,19	—
IT0005250946	BTP 2017-2020 0,35%	0,35	2017	—	15-VI-2020	15-VI; 15-XII	15-VI	11.544.220	558.795	11.544.220	1000	99,64	—
IT0005244782	BTP 2017-2022 1,2%	1,20	2017	—	01-IV-2022	01-IV; 01-X	01-IV	16.650.500	1.055.700	16.650.500	1000	100,46	—
IT0005246340	BTP 2017-2024 1,85%	1,85	2017	—	15-V-2024	15-V; 15-XI	15-V	12.412.500	654.606	12.412.500	1000	99,71	—
IT0005240830	BTP 2017-2027 2,20%	2,20	2017	—	01-VI-2027	01-VI; 01-XII	01-VI	13.162.500	3.755.669	13.162.500	1000	98,58	—
IT0005273013	BTP 2017-2048 3,45%	3,45	2017	—	01-III-2048	01-III; 01-IX	01-III	6.500.000	121.128	6.500.000	1000	98,96	—
IT0004969207	BTP Italia 2013-2017 2,15%	1,08	2013	—	12-XI-2017	12-V; 12-XI	12-XI	13.421.952	6.631.561	22.271.853	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.
IT0005012783	BTP Italia 2014-2020 1,65%	0,83	2014	—	23-IV-2020	23-IV; 23-X	23-IV	20.565	4.784.235	20.565	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.
IT0005105843	BTP Italia 2015-2023 0,5%	0,25	2015	—	20-IV-2023	20-IV; 20-X	20-IV	9.379.071	2.954.836	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%	0,05	2016	—	15-V-2022	15-V; 15-XI	15-V	7.045.526	785.857	7.045.526	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-X	11-IV	8.014.368	3.250.562	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	15-IX	13.077.270	111.044	13.684.800	1000	99,68	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004085210	BTPei 2006-2017 2,1%	1,05	2006	—	15-IX-2017	15-III; 15-IX	15-IX	13.515.756	66.985	14.551.332	1000	99,53	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0004243512	BTPei 2007-2023 2,6%	1,30	2007	—	15-IX-2023	15-III; 15-IX	15-IX	17.650.347	187.953	17.650.347	1000	99,09	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004380546	BTPei 2008-2019 2,35%	1,18	2008	—	15-IX-2019	15-III; 15-IX	15-IX	17.320.527	117.866	17.320.527	1000	99,79	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004545890	BTPei 2009-2041 2,55%	1,28	2009	—	15-IX-2041	15-III; 15-IX	15-IX	8.679.120	315.934	8.679.120	1000	98,89	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004604671	BTPei 2010-2021 2,1%	1,05	2010	—	15-IX-2021	15-III; 15-IX	15-IX	17.311.846	191.287	17.311.846	1000	99,33	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004735152	BTPei 2011-2026 3,1%	1,55	2011	—	15-IX-2026	15-III; 15-IX	15-IX	12.569.986	257.444	12.569.986	1000	100,03	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004890882	BTPei 2013-2018 1,7%	0,85	2013	—	15-IX-2018	15-III; 15-IX	15-IX	10.764.638	96.235	10.764.638	1000	99,50	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0005004426	BTPei 2014-2024 2,35%	1,18	2014	—	15-IX-2024	15-III; 15-IX	15-IX	13.238.201	208.471	13.238.201	1000	99,76	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0005138828	BTPei 2015-2032 1,25%	0,63	2015	—	15-IX-2032	15-III; 15-IX	15-IX	8.219.621	554.059	8.219.621	1000	99,77	Corresponsione di un premio all'atto del rimborso.
IT0005246134	BTPei 2016-2028 1,30%	0,65	2016	—	15-V-2028	15-V; 15-XI	15-V	3.983.500	338.499	3.983.500	1000	99,88	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004652175	CCTeu 2010-2017	0,28	2010	—	15-X-2017	15-IV; 15-X	15-X	12.975.343	659.108	15.646.286	1000	99,79	—
IT0004716319	CCTeu 2011-2018	0,39	2011	—	15-IV-2018	15-IV; 15-X	15-IV	13.717.165	898.725	14.526.409	1000	98,38	—
IT0004922909	CCTeu 2013-2018	0,79	2013	—	01-XI-2018	01-V; 01-XI	01-XI	12.458.026	874.872	13.484.709	1000	98,40	—
IT0005009839	CCTeu 2013-2019	0,49	2013	—	15-XI-2019	15-V; 15-XI	15-XI	12.679.855	825.845	12.679.855	1000	101,14	—
IT0005056541	CCTeu 2014-2020	0,27	2014	—	15-XII-2020	15-VI; 15-XII	15-XII	13.368.775	1.151.603	13.368.775	1000	100,34	—
IT0005104473	CCTeu 2014-2022	0,14	2014	—	15-VI-2022	15-VI; 15-XII	15-VI	16.453.945	2.542.537	16.453.945	1000	100,13	—
IT0005137614	CCTeu 2015-2022	0,22	2015	—	15-XII-2022	15-VI; 15-XII	15-XII	15.545.977	1.901.420	15.545.977	1000	99,93	—
IT0005185456	CCTeu 2016-2023	0,22	2016	—	15-VII-2023	15-I; 15-VII	15-VII	15.429.861	3.640.493	15.429.861	1000	100,38	—
IT0005218968	CCTeu 2016-2024	0,26	2016	—	15-II-2024	15-II; 15-VIII	15-II	14.956.168	4.297.552	14.956.168	1000	99,80	—
IT0005252520	CCTeu 2017-2024	0,43	2017	—	15-X-2024	15-IV; 15-X	15-X	8.287.500	1.625.257	8.287.500	1000	99,50	—
IT0005175366	CTZ 28-III-2018	—	2016	—	28-III-2018	—	28-III	11.302.936	291.224	11.302.936	1000	100,13	—
IT0005221285	CTZ 28-XII-2018	—	2016	—	28-XII-2018	—	28-XII	15.100.000	297.932	15.100.000	1000	99,41	—
IT0005256471	CTZ 30-V-2019	—	2017	—	30-V-2019	—	30-V	6.054.001	66.298	6.054.001	1000	100,16	—
IT0005126989	CTZ 30-VIII-2017	—	2015	—	30-VIII-2017	—	30-VIII	12.370.478	228.701	12.847.033	1000	99,67	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
US465410AH18	Republic of Italy 1993-2023 6,875% USD	6,88	1993	—	27-IX-2023	27-III; 27-IX	27-IX	USD 3.500.000	USD 65.804	USD 3.500.000	USD	1.000	98,73	—
XS0100688190	Republic of Italy 1999-2019 Euro CMS	—	1999	—	30-VIII-2019	30-VIII	30-VIII	1.000.000	55.955	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	55.295	1.000.000		1000	101,60	—
US465410BG26	Republic of Italy 2003-2033 5,375% USD	5,38	2003	—	15-VI-2033	15-VI; 15-XII	15-VI	USD 2.000.000	USD 261.699	USD 2.000.000	USD	1.000	98,44	—
DE0001141646	BOBL 2012-2017 0,5%	0,50	2012	—	13-X-2017	13-X	13-X	5.000.000	7.101	5.000.000		0,01	99,43	—
DE0001141661	BOBL 2013-2018 0,25%	0,25	2013	—	13-IV-2018	13-IV	13-IV	5.000.000	2.887	5.000.000		0,01	99,38	—
DE0001141679	BOBL 2013-2018 1%	1,00	2013	—	12-X-2018	12-X	12-X	5.000.000	1.817	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	3.620	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	2.921	500.000		0,01	99,66	—
DE0001141687	BOBL 2014-2019 1%	1,00	2014	—	22-II-2019	22-II	22-II	5.000.000	561	5.000.000		0,01	100,50	—
DE0001141711	BOBL 2015-2020 0%	—	2015	—	17-IV-2020	17-IV	17-IV	5.000.000	5.193	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	807	9.000.000		0,01	100,43	—
DE0001141737	BOBL 2016-2021 0%	—	2016	—	09-IV-2021	09-IV	09-IV	5.000.000	1.751	5.000.000		0,01	101,24	—
DE0001141745	BOBL 2016-2021 0%	—	2016	—	08-X-2021	08-X	08-X	5.000.000	2.415	5.000.000		0,01	102,71	—
DE0001141752	BOBL 2017-2022 0%	—	2017	—	08-IV-2022	08-IV	08-IV	4.000.000	1.527	4.000.000		0,01	100,00	—
ES00000123Q7	Bonos 2012-2018 4,5%	4,50	2012	—	31-I-2018	31-I	31-I	9.465.500	1.296	9.465.500		1000	99,20	—
ES00000124B7	Bonos 2013-2018 3,75%	3,75	2013	—	31-X-2018	31-X	31-X	9.277.600	3.034	9.277.600		1000	99,82	—
ES00000126V0	Bonos 2014-2017 0,5%	0,50	2014	—	31-X-2017	31-X	31-X	4.369.800	19.673	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	36.105	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	2.009	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	5.271	6.239.500		1000	100,01	—
ES00000127H7	Bonos 2015-2020 1,15%	1,15	2015	—	30-VII-2020	30-VII	30-VII	3.218.130	1.863	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	2.671	3.218.140		1000	99,88	—
ES00000128B8	Bonos 2016-2021 0,75%	0,75	2016	—	30-VII-2021	30-VII	30-VII	10.763.603	8.179	10.763.603		1000	100,29	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
ES0000012801	Bonos 2017-2022 0,4%	0,40	2017	—	30-IV-2022	30-IV	30-IV	3.202.250	793	3.202.250	1000	100,00	—
ES00000126W8	Bonosei 2013-2019 0,55%	0,55	2013	—	30-XI-2019	30-XI	30-XI	5.000.000	2.164	5.000.000	1000	101,54	—
FR0120746609	BTAN 2011-2017 1%	1,00	2011	—	25-VII-2017	25-VII	25-VII	18.029.000	4.156	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	3.436	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	6.275	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	2.100	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	5.399	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	1.405	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	4.391	23.000.000	0,01	99,21	—
DE0001135333	Bund 2007-2017 4,25%	4,25	2007	—	04-VII-2017	04-VII	04-VII	19.000.000	3.522	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	5.636	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	1.702	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	2.343	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	3.623	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	4.339	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	4.686	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	2.512	6.000.000	0,01	98,95	—
DE0001135416	Bund 2010-2020 2,25%	2,25	2010	—	04-IX-2020	04-IX	04-IX	6.000.000	4.734	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	4.276	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	1.270	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	6.872	4.000.000	0,01	98,38	—
DE0001135457	Bund 2011-2021 2,25%	2,25	2011	—	04-IX-2021	04-IX	04-IX	6.000.000	5.209	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	2.681	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	3.645	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	1.629	5.000.000	0,01	100,76	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
DE0001135473	Bund 2012-2022 1,75%	1,75	2012	—	04-VII-2022	04-VII	04-VII	5.000.000	3.837	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	3.091	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	38.169	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	3.671	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	3.448	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	3.029	5.000.000	0,01	100,84	—
DE0001102325	Bund 2013-2023 2%	2,00	2013	—	15-VIII-2023	15-VIII	15-VIII	5.000.000	2.833	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	1.552	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	25.265	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	5.603	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	6.300	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	3.116	5.000.000	0,01	101,18	—
DE0001102408	Bund 2016-2026 0%	—	2016	—	15-VIII-2026	15-VIII	15-VIII	5.000.000	30.550	5.000.000	0,01	100,48	—
DE0001102390	Bund 2016-2026 0,5%	0,50	2016	—	15-II-2026	15-II	15-II	5.000.000	65.510	5.000.000	0,01	99,11	—
DE0001102416	Bund 2017-2027 0,25%	0,25	2017	—	15-II-2027	15-II	15-II	5.000.000	15.431	5.000.000	0,01	98,91	—
DE0001030559	Bundei 2014-2030 0,5%	0,50	2014	—	15-IV-2030	15-IV	15-IV	3.000.000	1.287	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	2.094	4.000.000	0,01	111,58	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
DE0001030526	Federal Republic of Germany 2009-2020 Inflation-Linked Bonds ¹⁾	1,75	2009	—	15-IV-2020	15-IV	15-IV	7.000.000	517	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	967	12.000.000	0,01	99,47	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
GR0128010676	GGB 2012-2023 Step Up 2%	3,00	2012	—	24-II-2023	24-II	24-II	2.962.803	32.185	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	11.528	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	10.367	2.962.803	1	100,00	—
GR0128013704	GGB 2012-2026 Step Up 2% ¹⁾	3,00	2012	—	24-II-2026	24-II	24-II	2.962.803	12.431	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	9.763	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 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
GR0133006198	GGB 2012-2028 Step Up 2%	1)	3,00	2012	—	24-II-2028	24-II	24-II	3.160.323	13.201	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	11.630	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	15.941	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	8.111	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	8.563	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	11.207	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	9.382	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	12.812	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	14.548	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	25.760	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	17.100	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	20.064	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	18.737	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	17.687	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	46.427	3.160.323	1	100,00	—
GR0110029312	GGB 2014-2017 3,375%		3,38	2014	—	17-VII-2017	17-VII	17-VII	1.500.000	82.617	1.500.000	1000	99,65	—
GR0114028534	GGB 2014-2019 4,75%		4,75	2014	—	17-IV-2019	17-IV	17-IV	3.000.000	181.240	3.000.000	1000	99,13	—
ES0L01712089	Letras 08-XII-2017		—	2016	—	08-XII-2017	—	08-XII	5.890.590	1.272	5.890.590	1000	100,23	—
ES0L01708186	Letras 18-VIII-2017		—	2016	—	18-VIII-2017	—	18-VIII	7.613.014	501	7.613.014	1000	100,20	—
FR0000571218	OAT 1997-2029 5,5%		5,50	1997	—	25-IV-2029	25-IV	25-IV	15.500.880	5.561	15.500.880	1	97,68	—
FR0000187635	OAT 2000-2032 5,75%		5,75	2000	—	25-X-2032	25-X	25-X	18.738.000	6.840	18.738.000	1	99,53	—
FR0000189151	OAT 2003-2019 4,25%		4,25	2003	—	25-IV-2019	25-IV	25-IV	28.002.000	2.710	28.002.000	1	99,85	—
FR0010070060	OAT 2003-2035 4,75%		4,75	2003	—	25-IV-2035	25-IV	25-IV	14.664.000	4.117	14.664.000	1	99,54	—
FR0010192997	OAT 2005-2021 3,75%		3,75	2005	—	25-IV-2021	25-IV	25-IV	12.849.000	1.268	12.849.000	1	99,92	—
FR0010371401	OAT 2005-2038 4%		4,00	2005	—	25-X-2038	25-X	25-X	4.297.000	2.931	4.297.000	1	98,25	—

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 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
FR0010517417	OAT 2006-2017 4,25%	4,25	2006	—	25-X-2017	25-X	25-X	12.203.000	1.371	12.203.000	1	99,17	—
FR0010466938	OAT 2006-2023 4,25%	4,25	2006	—	25-X-2023	25-X	25-X	6.470.000	1.200	6.470.000	1	98,36	—
FR0010604983	OAT 2007-2018 4%	4,00	2007	—	25-IV-2018	25-IV	25-IV	5.765.000	823	5.765.000	1	98,10	—
FR0010949651	OAT 2009-2020 2,5%	2,50	2009	—	25-X-2020	25-X	25-X	10.389.000	2.446	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	1.580	5.375.000	1	99,30	—
FR0010773192	OAT 2009-2041 4,5%	4,50	2009	—	25-IV-2041	25-IV	25-IV	11.968.000	1.117	11.968.000	1	99,57	—
FR0010870956	OAT 2009-2060 4%	4,00	2009	—	25-IV-2060	25-IV	25-IV	11.918.000	2.203	11.918.000	1	96,34	—
FR0011059088	OAT 2010-2021 3,25%	3,25	2010	—	25-X-2021	25-X	25-X	27.953.000	525	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	3.014	4.690.000	1	99,47	—
FR0011196856	OAT 2011-2022 3%	3,00	2011	—	25-IV-2022	25-IV	25-IV	17.255.000	721	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	1.936	3.796.000	1	98,82	—
FR0011394345	OAT 2012-2018 1%	1,00	2012	—	25-V-2018	25-V	25-V	16.211.000	3.009	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	1.855	4.291.000	1	99,45	—
FR0011461037	OAT 2012-2045 3,25%	3,25	2013	—	25-V-2045	25-V	25-V	6.160.000	2.483	6.160.000	1	99,74	—
FR0011523257	OAT 2013-2018 1%	1,63	2013	—	25-XI-2018	25-XI	25-XI	8.890.000	1.230	8.890.000	1	98,72	—
FR0011962398	OAT 2013-2024 1,75%	1,75	2013	—	25-XI-2024	25-XI	25-XI	5.390.000	1.403	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	1.263	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	3.938	4.130.000	1	98,18	—
FR0012557957	OAT 2014-2020 0%	—	2014	—	25-V-2020	25-V	25-V	8.006.000	605	8.006.000	1	99,46	—
FR0012968337	OAT 2014-2020 0,25%	0,25	2014	—	25-XI-2020	25-XI	25-XI	8.061.000	937	8.061.000	1	99,67	—
FR0012517027	OAT 2014-2025 0,5%	0,50	2014	—	25-V-2025	25-V	25-V	4.625.000	4.704	4.625.000	1	98,87	—
FR0012938116	OAT 2014-2025 1%	1,00	2014	—	25-XI-2025	25-XI	25-XI	6.633.000	20.441	6.633.000	1	98,02	—
FR0012634558	OAT 2015-2018 0%	—	2015	—	25-II-2018	25-II	25-II	3.505.000	1.169	3.505.000	1	100,33	—
FR0013101466	OAT 2015-2019 0%	—	2015	—	26-II-2019	25-II	26-II	4.408.000	1.164	4.408.000	1	100,61	—
FR0013157096	OAT 2015-2021 0%	—	2015	—	25-V-2021	25-V	25-V	4.095.000	20.274	4.095.000	1	100,74	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
FR0013200813	OAT 2015-2026 0,25%	0,25	2015	—	25-XI-2026	25-XI	25-XI	5.570.000	42.852	5.570.000	1	99,94	—
FR0013131877	OAT 2015-2026 0,5%	0,50	2015	—	25-V-2026	25-V	25-V	5.100.000	34.068	5.100.000	1	98,69	—
FR0012993103	OAT 2015-2031 1,5%	1,50	2015	—	25-V-2031	25-V	25-V	4.964.000	4.097	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	30.118	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	23.885	3.000.000	1	94,68	—
FR0013219177	OAT 2016-2022 0%	—	2016	—	25-V-2022	25-V	25-V	7.379.000	601	7.379.000	1	100,15	—
FR0013234333	OAT 2016-2039 1,75	1,75	2016	—	25-VI-2039	25-VI	25-VI	7.000.000	1.219	7.000.000	1	100,00	—
FR0000188799	OATei 2002-2032 3,15%	3,90	2002	—	25-VII-2032	25-VII	25-VII	6.794.000	740	6.794.000	1	99,02	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0010050559	OATei 2003-2020 2,25%	2,75	2003	—	25-VII-2020	25-VII	25-VII	6.454.000	1.075	6.454.000	1	98,37	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0010447367	OATei 2006-2040 1,8%	2,03	2006	—	25-VII-2040	25-VII	25-VII	6.814.000	671	6.814.000	1	98,15	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0010899765	OATei 2009-2022 1,1%	1,17	2009	—	25-VII-2022	25-VII	25-VII	4.023.000	1.448	4.023.000	1	97,27	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0011427848	OATei 2012-2024 0,25%	0,25	2014	—	25-VII-2024	25-VII	25-VII	5.490.000	763	5.490.000	1	96,81	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0011982776	OATei 2013-2030 0,7%	0,70	2013	—	25-VII-2030	25-VII	25-VII	3.500.000	1.374	3.500.000	1	99,09	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0013209871	OATei 2016-2047 0,1%	0,10	2016	—	25-VII-2047	25-VII	25-VII	4.000.000	1.533	4.000.000	1	111,63	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0010235176	OATi 2005-2017 1%	1,14	2005	—	25-VII-2017	25-VII	25-VII	3.721.000	8.190	3.721.000	1	98,55	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
FR0010850032	OATi 2009-2019 1,3%	1,37	2009	—	25-VII-2019	25-VII	25-VII	4.818.000	1.340	4.818.000	1	99,01	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
ES0000011868	Obligaciones del Estado 1999-2029 6%	6,00	1999	—	31-I-2029	31-I	31-I	8.859.768	14.730	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	18.065	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	1.260	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	18.232	15.994.400	1000	98,85	—
ES00000120N0	Obligaciones del Estado 2007-2040 4,9%	4,90	2007	—	30-VII-2040	30-VII	30-VII	13.373.900	1.164	13.373.900	1000	99,66	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
ES00000121A5	Obligaciones del Estado 2008-2018 4,1%	4,10	2008	—	30-VII-2018	30-VII	30-VII	15.820.900	1.109	15.820.900	1000	99,21	—
ES00000122D7	Obligaciones del Estado 2010-2020 4%	4,00	2010	—	30-IV-2020	30-IV	30-IV	8.070.340	975	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	2.688	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	9.951	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	776	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	2.810	4.000.000	1000	98,94	—
ES00000123X3	Obligaciones del Estado 2013-2023 4,4%	4,40	2013	—	31-X-2023	31-X	31-X	14.019.500	22.547	14.019.500	1000	99,6	—
ES00000123U9	Obligaciones del Estado 2013-2023 5,4%	5,40	2013	—	31-I-2023	31-I	31-I	10.126.200	620	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	6.616	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	1.267	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	891	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	8.910	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	9.966	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	31.858	7.000.000	1000	99,6	—
ES00000128H5	Obligaciones del Estado 2016-2026 1,3%	1,30	2016	—	31-X-2026	31-X	31-X	6.000.000	19.803	6.000.000	1000	100,00	—
ES00000127Z9	Obligaciones del Estado 2016-2026 1,95%	1,95	2016	—	30-IV-2026	30-IV	30-IV	9.000.000	62.119	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	27.364	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	17.255	3.000.000	1000	100,00	—
ES00000128P8	Obligaciones del Estado 2017-2027 1,5%	1,50	2017	—	30-IV-2027	30-IV	30-IV	9.000.000	1.090	9.000.000	1000	99,3	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
ES00000128Q6	Obligaciones del Estado 2017-2033 2,35%	2,35	2017	—	30-VII-2033	30-VII	30-VII	5.000.000	1.826	5.000.000	1000	100,00	—
ES00000126A4	Obligacionesei 2013-2024 1,8%	1,80	2013	—	30-XI-2024	30-XI	30-XI	6.004.100	7.821	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	9.041	3.500.000	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
ES00000128D4	Obligacionesei 2015-2021 0,3%	0,30	2015	—	30-XI-2021	30-XI	30-XI	2.975.104	2.042	2.975.104	1000	102,28	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
PTOTE5OE0007	Obrigacoes do Tesouro 2006-2037 4,1%	4,10	2014	—	15-IV-2037	15-IV	15-IV	6.973.000	455.974	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	2.384	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	3.943	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	10.207	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	7.266	10.915.000	0,01	99,97	—
PTOTECOE0029	Obrigacoes do Tesouro 2010-2020 4,8%	4,80	2014	—	15-VI-2020	15-VI	15-VI	8.551.000	15.971	8.551.000	0,01	99,84	—
PTOTEQOE0015	Obrigacoes do Tesouro 2013-2024 5,65%	5,65	2014	—	15-II-2024	15-II	15-II	6.000.000	14.163	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	54.631	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	82.764	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	76.276	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	907.436	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	304.827	4.000.000	0,01	99,14	—
PTOTEUOE0019	Obrigacoes do Tesouro 2017-2027 4,125%	4,13	2017	—	14-IV-2027	14-IV	14-IV	3.000.000	165.165	3.000.000	0,01	100,00	—
NL0000102275	Regno dei Paesi Bassi 2006-2023 3,75%	3,75	2006	—	15-I-2023	15-I	15-I	4.263.000	520	4.263.000	1	100,52	—
NL0006007239	Regno dei Paesi Bassi 2007-2017 4,5%	4,50	2007	—	15-VII-2017	15-VII	15-VII	14.654.990	738	14.654.990	1	99,22	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
NL0006227316	Regno dei Paesi Bassi 2008-2018 4%	4,00	2008	—	15-VII-2018	15-VII	15-VII	15.022.020	993	15.022.020	1	98,45	—
NL0009712470	Regno dei Paesi Bassi 2011-2021 3,25%	3,25	2011	—	15-VII-2021	15-VII	15-VII	16.493.985	4.433	16.493.985	1	97,92	—
NL0010200606	Regno dei Paesi Bassi 2012-2018 1,25%	1,25	2012	—	15-I-2018	15-I	15-I	15.258.425	1.434	15.258.425	1	99,71	—
NL0010071189	Regno dei Paesi Bassi 2012-2033 2,5%	2,50	2014	—	15-I-2033	15-I	15-I	10.048.900	23.981	10.048.900	1	96,29	—
NL0010514246	Regno dei Paesi Bassi 2013-2019 1,25%	1,25	2013	—	15-I-2019	15-I	15-I	15.021.224	563	15.021.224	1	99,25	—
NL0010733424	Regno dei Paesi Bassi 2014-2019 2%	2,00	2014	—	15-VII-2024	15-VII	15-VII	11.342.132	1.768	11.342.132	1	100,30	—
NL0010881827	Regno dei Paesi Bassi 2014-2020 0,25%	0,25	2014	—	15-I-2020	15-I	15-I	15.318.184	15.519	15.318.184	1	99,35	—
BE0000291972	Regno del Belgio 1997-2028 5,5%	5,50	2013	—	28-III-2028	28-III	28-III	16.638.939	1.115	16.638.939	0,01	98,93	—
BE0000300096	Regno del Belgio 2002-2017 5,5%	5,50	2002	—	28-IX-2017	28-IX	28-IX	8.437.638	633	8.437.638	0,01	99,43	—
BE0000304130	Regno del Belgio 2004-2035 5%	5,00	2014	—	28-III-2035	28-III	28-III	18.111.693	2.898	18.111.693	0,01	98,84	—
BE0000312216	Regno del Belgio 2008-2018 4%	4,00	2014	—	28-III-2018	28-III	28-III	11.428.000	548	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	814	17.634.000	0,01	99,03	—
BE0000320292	Regno del Belgio 2010-2041 4,25%	4,25	2010	—	28-III-2041	28-III	28-III	14.355.000	711	14.355.000	0,01	99,62	—
BE0000321308	Regno del Belgio 2011-2021 4,25%	4,25	2014	—	28-IX-2021	28-IX	28-IX	14.921.000	3.429	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	2.774	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	3.587	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	1.732	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	590	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 1.655	USD 1.000.000	USD 1.000	99,63	—
BE0000331406	Regno del Belgio 2013-2045 3,75%	3,75	2013	—	22-VI-2045	22-VI	22-VI	4.000.000	1.047	4.000.000	0,01	96,38	—
BE0000332412	Regno del Belgio 2014-2024 2,6%	2,60	2014	—	22-VI-2024	22-VI	22-VI	5.000.000	579	5.000.000	0,01	99,66	—
BE0000334434	Regno del Belgio 2015-2025 0,8%	0,80	2015	—	22-VI-2025	22-VI	22-VI	5.000.000	837	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	11.244	4.000.000	0,01	99,06	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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	576	4.000.000	0,01	100,00	—
BE0000337460	Regno del Belgio 2016-2026 1%	1,00	2016	—	22-VI-2026	22-VI	22-VI	5.000.000	2.069	5.000.000	0,01	99,71	—
BE0000338476	Regno del Belgio 2016-2047 1,6%	1,60	2016	—	22-VI-2047	22-VI	22-VI	3.500.000	6.954	3.500.000	0,01	100,00	—
BE0000340498	Regno del Belgio 2016-2066 2,15%	2,15	2016	—	22-VI-2066	22-VI	22-VI	3.000.000	2.884	3.000.000	0,01	100,00	—
BE0000341504	Regno del Belgio 2017-2027 0,8%	0,80	2017	—	22-VI-2027	22-VI	22-VI	6.000.000	525	6.000.000	0,01	100,00	—
XS1231271294	Regno di Svezia 2015-2018 1,125% USD	1,13	2015	—	15-V-2018	15-V; 15-XI	15-V	USD 2.250.000	USD 800	USD 2.250.000	USD 1.000	99,97	—
NL0000102317	Regno d'Olanda 1998-2028 5,5%	5,50	1998	—	15-I-2028	15-I	15-I	13.028.814	1.762	13.028.814	1	100,27	—
NL0009086115	Regno d'Olanda 2009-2019 4%	4,00	2009	—	15-VII-2019	15-VII	15-VII	13.006.398	1.029	13.006.398	1	99,07	—
NL0009446418	Regno d'Olanda 2010-2042 3,75%	3,75	2010	—	15-I-2042	15-I	15-I	15.331.910	2.378	15.331.910	1	99,05	—
NL0010060257	Regno d'Olanda 2012-2022 2,25%	2,25	2012	—	15-VII-2022	15-VII	15-VII	15.252.147	735	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	864	15.533.963	1	99,25	—
NL0011220108	Regno d'Olanda 2015-2025 0,25%	0,25	2015	—	15-VII-2025	15-VII	15-VII	11.772.159	5.787	11.772.159	1	98,62	—
NL0011819040	Regno d'Olanda 2016-2026 0,50%	0,50	2016	—	15-VII-2026	15-VII	15-VII	15.113.051	1.528	15.113.051	1	100,56	—
US445545AE60	Repubblica di Ungheria 2011-2021 6,375% USD	6,38	2011	—	29-III-2021	29-III; 29-IX	29-III	USD 3.000.000	USD 570	USD 3.000.000	USD 2.000	99,06	—
IT0006527532	Repubblica Ellenica 1999-2019 5%	5,00	1999	—	11-III-2019	11-III	11-III	200.000	21.164	200.000	1000	100,00	—
FI4000010848	Repubblica Finlandese 2010-2020 3,7%	3,70	2010	—	15-IV-2020	15-IV	15-IV	6.500.000	1.038	6.500.000	1000	99,91	—
FI4000047089	Repubblica Finlandese 2012-2022 1,62%	1,62	2014	—	15-IX-2022	15-IX	15-IX	500.000	1.251	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	2.597	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	1.899	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	766	5.001.000	1000	99,73	—
FI4000062625	Repubblica Finlandese 2013-2023 1,5%	1,50	2013	—	15-IV-2023	15-IV	15-IV	5.000.000	700	5.000.000	1000	99,18	—
FI4000106117	Repubblica Finlandese 2014-2020 0,37%	0,37	2014	—	15-IX-2020	15-IX	15-IX	5.001.000	720	5.001.000	1000	99,41	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
FI4000148630	Repubblica Finlandese 2015-2031 0,75%	0,75	2015	—	15-IV-2031	15-IV	15-IV	3.000.000	7.763	3.000.000	1000	98,59	—
FI4000219787	Repubblica Finlandese 2016-2023 0%	—	2016	—	15-IX-2023	15-IX	15-IX	3.000.000	745	3.000.000	1000	100,00	—
FI4000197959	Repubblica Finlandese 2016-2026 0,5%	0,50	2016	—	15-IV-2026	15-IV	15-IV	4.000.000	600	4.000.000	1000	100,00	—
US731011AR30	Repubblica Polacca 2009-2019 6,375% USD	6,38	2009	—	15-VII-2019	15-I; 15-VII	15-VII	USD 3.500.000	USD 1.120	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-X	21-IV	USD 2.000.000	USD 1.181	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-IX	23-III	USD 3.000.000	USD 2.827	USD 3.000.000	USD 1.000	98,61	—
US731011AT95	Repubblica Polacca 2012-2023 3% USD	3,00	2012	—	17-III-2023	17-III; 17-IX	17-III	USD 2.000.000	USD 70.117	USD 2.000.000	USD 1.000	98,45	—
XS1015428821	Repubblica Polacca 2014-2024 3%	3,00	2014	—	15-I-2024	15-I	15-I	2.000.000	1.050	2.000.000	1000	99,73	—
US857524AC63	Repubblica Polacca 2014-2024 4% USD	4,00	2014	—	22-I-2024	22-I; 22-VII	22-I	USD 2.000.000	USD 5.310	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	587	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	2.397	1.000.000	1000	98,34	—
XS1536786939	Repubblica Polacca 2016-2021 0,5%	0,50	2016	—	20-XII-2021	20-XII	20-XII	18.000.000	748	18.000.000	1000	100,00	—
XS1346201616	Repubblica Polacca 2016-2026 1,5%	1,50	2016	—	19-I-2026	19-I	19-I	1.000.000	964	1.000.000	1000	99,61	—
US731011AU68	Repubblica Polacca 2016-2026 3,25% USD	3,25	2016	—	06-IV-2026	06-IV; 06-X	06-IV	USD 1.750.000	USD 12.187	USD 1.750.000	USD 1.000	99,25	—
XS1508566392	Repubblica Polacca 2016-2028 1%	1,00	2016	—	25-X-2028	25-X	25-X	750.000	795	750.000	1000	100,00	—
XS1346201889	Repubblica Polacca 2016-2036 2,375%	2,38	2016	—	18-I-2036	18-I	18-I	750.000	1.909	750.000	1000	100,00	—
XS1508566558	Repubblica Polacca 2016-2046 2%	2,00	2016	—	25-X-2046	25-X	25-X	500.000	2.196	500.000	1000	100,00	—
XS1085735899	Repubblica Portoghese 2014-2024 5,12% USD	5,12	2014	—	15-X-2024	15-IV; 15-X	15-X	USD 4.500.000	USD 421.637	USD 4.500.000	USD 1.000	99,22	—
AT0000385745	Republic of Austria 2003-2018 4,65%	4,65	2003	—	15-I-2018	15-I	15-I	11.256.606	774	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	3.026	11.672.610	1000	99,15	—
XS0216258763	Republic of Austria 2005-2020 CMS Spread Floater Notes	0,23	2005	—	22-IV-2020	22-IV; 22-X	22-IV	200.000	4.366	200.000	1000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS0221500571	Republic of Austria 2005-2020 FRN Capped	0,17	2005	—	29-VI-2020; 29-IX; 29-XII	29-III; 29-VI	29-VI	100.000	1.568	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	768	12.910.820	1000	99,80	—
IT0006592080	Republic of Austria 2005-2022 CMS-Linked Flippable	—	2005	—	22-VI-2022	22-VI	22-VI	125.000	3.876	125.000	1000	100,00	—
XS0229808315	Republic of Austria 2005-2025 CMS Spread-Linked	0,63	2005	—	10-X-2025	10-IV; 10-X	10-X	120.000	8.052	120.000	1000	100,00	—
XS0224713254	Republic of Austria 2005-2025 CMS-Linked	1,00	2005	—	28-VII-2025	28-VII	28-VII	50.000	785	50.000	1000	100,00	—
XS0231558858	Republic of Austria 2005-2035 Fixed to CMS-Linked	0,18	2005	—	24-X-2035	24-X	24-X	75.000	5.322	75.000	1000	100,00	—
AT0000A06P24	Republic of Austria 2007-2017 4,3%	4,30	2007	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	6.719.300	3.737	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	513	11.317.729	1000	99,90	—
AT0000A0DXC2	Republic of Austria 2009-2026 4,85%	4,85	2009	—	15-III-2026	15-III	15-III	5.355.801	717	5.355.801	1000	99,79	—
AT0000A0N9A0	Republic of Austria 2011-2022 3,65%	3,65	2013	—	20-IV-2022	20-IV	20-IV	7.875.171	2.497	7.875.171	1000	99,66	—
AT0000A12B06	Republic of Austria 2013-2018 1,15%	1,15	2014	—	19-X-2018	19-X	19-X	6.420.000	642	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	1.387	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	3.046	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	619	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	868	4.000.000	1000	99,45	—
AT0000A1PE50	Republic of Austria 2016-2023 0%	0,00	2016	—	15-VII-2023	15-VII	15-VII	3.000.000	566	3.000.000	1000	100,00	—
AT0000A1K9C8	Republic of Austria 2016-2026 0,75%	0,75	2016	—	20-X-2026	20-X	20-X	3.500.000	3.197	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	2.349	1.500.000	1000	99,93	—
AT0000A1PEF7	Republic of Austria 2016-2086 1,50%	1,50	2016	—	02-XI-2086	02-XI	02-XI	2.000.000	19.772	2.000.000	1000	100,00	—
IE0034074488	Republic of Ireland 2004-2020 4,5%	4,50	2004	—	18-IV-2020	18-IV	18-IV	11.608.770	4.855	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	2.530	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	532	7.700.060	0,01	99,03	—
IE00B6089D15	Republic of Ireland 2009-2019 5,9%	5,90	2009	—	18-X-2019	18-X	18-X	6.766.580	657	6.766.580	0,01	99,79	—
IE00B4TV0D44	Republic of Ireland 2009-2025 5,4%	5,40	2009	—	13-III-2025	13-III	13-III	11.745.350	3.045	11.745.350	0,01	99,30	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IE00B60Z6194	Republic of Ireland 2010-2020 5%	5,00	2010	—	18-X-2020	18-X	18-X	9.051.990	844	9.051.990	0,01	99,28	—
IE00BJ38CR43	Republic of Ireland 2014-2030 2,4%	2,40	2014	—	15-V-2030	15-V	15-V	3.750.000	510	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	523	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	8.288	4.000.000	0,01	98,05	—
IE00BV8C9418	Republic of Ireland 2016-2026 1%	1,00	2016	—	15-V-2026	15-V	15-V	3.000.000	5.122	3.000.000	0,01	98,49	—
IE00BV8C9B83	Republic of Ireland 2017-2037 1,7%	1,70	2017	—	15-V-2037	15-V	15-V	4.000.000	891	4.000.000	0,01	100,00	—
DE0001104610	Schatz 2015-2017 0%	—	2015	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	5.000.000	6.312	5.000.000	0,01	100,52	—
DE0001104628	Schatz 2015-2017 0%	—	2015	—	15-XII-2017	15-XII	15-XII	5.000.000	5.132	5.000.000	0,01	100,80	—
DE0001104636	Schatz 2016-2018 0%	—	2016	—	12-II-2016	16-III	—	5.000.000	7.944	5.000.000	0,01	101,06	—
DE0001104644	Schatz 2016-2018 0%	—	2016	—	15-VI-2018	15-VI	15-VI	5.000.000	2.063	5.000.000	0,01	101,09	—
DE0001104669	Schatz 2016-2018 0%	—	2016	—	14-XII-2018	14-XII	14-XII	5.000.000	1.525	5.000.000	0,01	101,35	—
DI ENTI E SOCIETÀ													
XS0859920406	A2A 2012-2019 4,5%	4,50	2012	—	28-XI-2019	28-XI	28-XI	750.000	1.200	750.000	1000	99,72	—
XS0951567030	A2A 2013-2021 4,375%	4,38	2013	—	10-I-2021	10-I	10-I	500.000	1.800	500.000	100000	99,32	—
XS1195347478	A2A 2015-2025 1,75%	1,75	2015	—	25-II-2025	25-II	25-II	300.000	700	300.000	1000	99,92	—
XS0495012428	Acea 2010-2020 4,5% Callable	4,50	2010	—	16-III-2020	16-III	16-III	500.000	600	500.000	1000	99,78	Facoltà di rimborso anticipato con preavviso di almeno 30 giorni lavorativi.
IT0005075533	Alerion Clean Power 2015-2022 6% Callable	6,00	2015	—	11-II-2022	11-II	11-II	130.000	67.106	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.
XS1224617347	Ansaldo Energia 2015-2020 2,875%	2,88	2015	—	28-IV-2020	28-IV	28-IV	420.000	1.100	420.000	1000	100,00	—
XS0452314536	Assicurazioni Generali 2009-2024 5,125%	5,13	2009	—	16-IX-2024	16-IX	16-IX	1.750.000	4.350	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	1.200	1.250.000	1000	99,60	—
XS1000393899	Astaldi 2013-2020 7,125% Callable	7,13	2013	—	01-XII-2020	01-VI; 01-XII	01-XII	750.000	37.200	750.000	1000	100,00	Dal 05-12-2013 al 01-12-2016 l'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito fino al 35% dell'ammontare.
XS0542534192	Atlantia 2010-2025 4,375%	4,38	2010	—	18-IX-2025	18-IX	18-IX	500.000	2.900	500.000	1000	99,37	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0004869985	Atlantia 2012-2018 3,625%	3,63	2012	—	30-XI-2018	30-XI	30-XI	1.000.000	8.330	1.000.000	1000	99,59	—
XS0828749761	Atlantia 2012-2020 4,375%	4,38	2012	—	16-III-2020	16-III	16-III	750.000	1.300	750.000	1000	99,44	—
XS0986174851	Atlantia 2013-2021 2,875%	2,88	2013	—	26-II-2021	26-II	26-II	750.000	2.300	750.000	1000	99,17	—
XS1558491855	Atlantia 2017-2025 1,625%	1,63	2017	—	03-II-2025	03-II	03-II	750.000	3.600	750.000	1000	99,94	—
XS1316567343	Autostrade per l'Italia 2015-2021 1,125%	1,13	2015	—	04-XI-2021	04-XI	04-XI	600.000	1.200	600.000	1000	99,80	—
IT0005108490	Autostrade per l'Italia 2015-2023 1,625%	1,63	2015	—	12-VI-2023	12-VI	12-VI	750.000	59.425	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	800	750.000	1000	100,00	—
XS1528093799	Autostrade per l'Italia 2016-2027 1,75%	1,75	2016	—	01-II-2027	01-II	01-II	600.000	800	600.000	1000	99,05	—
XS1533918584	Azimut Holding 2017-2022 2%	2,00	2017	—	28-III-2022	28-III	28-III	350.000	2.300	350.000	1000	100,00	—
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	25.000	5.020	25.000	1000	100,00	—
XS0570270370	Banca Carige 2010-2020 7,321%	7,32	2014	—	20-XII-2020	20-XII	20-XII	200.000	20.050	200.000	1000	100,00	—
IT0000966017	Banca Commerciale Italiana 1997-2027 Zero Coupon	—	1997	—	08-I-2027	—	08-I	263.775	54.559	339.312	0,01	10,85	—
IT0001200390	Banca Commerciale Italiana 1998-2028 Zero Coupon	—	1998	—	17-II-2028	—	17-II	383.634	100.180	516.457	0,01	18,65	—
XS1617701161	Banca Ifis 2017-2020 1,75%	1,75	2017	—	26-V-2020	26-V	26-V	300.000	5.000	300.000	1000	99,71	—
IT0004648694	Banca IMI 2010-2017 Tasso Misto 1)	0,00	2010	—	10-XI-2017	10-XI	10-XI	13.515	4.477	13.515	1000	100,00	—
IT0004796451	Banca IMI 2012-2018 Collezione Step Up 2)	4,85	2012	—	06-III-2018	06-III	06-III	46.740	4.753	100.000	1000	99,25	—
IT0004863723	Banca IMI 2012-2019 4,1%	4,10	2012	—	18-X-2019	18-X	18-X	150.000	1.706	150.000	1000	99,61	—
IT0004863731	Banca IMI 2012-2019 4,4% USD	4,40	2012	—	18-X-2019	18-X	18-X	USD 150.000	USD 8.978	USD 150.000	USD 2.000	99,45	—
IT0004960354	Banca IMI 2013-2017 4,35% NOK	4,35	2013	—	13-IX-2017	13-IX	13-IX	NOK 2.100.000	NOK 63.735	NOK 2.100.000	NOK 15.000	99,10	—
IT0004918402	Banca IMI 2013-2018 2,3% CHF	2,30	2013	—	19-IV-2018	19-IV	19-IV	CHF 150.000	CHF 862	CHF 150.000	CHF 1.000	99,78	—
IT0004892755	Banca IMI 2013-2018 3,4% USD	3,40	2013	—	12-II-2018	12-II	12-II	USD 150.000	USD 13.324	USD 150.000	USD 2.000	99,60	—
IT0004938269	Banca IMI 2013-2018 6,4% AUD	6,40	2013	—	28-VI-2018	28-VI	28-VI	AUD 300.000	AUD 23.830	AUD 300.000	AUD 1.000	98,80	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 2,2%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse a crescere pari al 3,35%, 3,65%, 3,95%, 4,25%, 4,55% e 4,85% annuo.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
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 ¹⁾	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 ²⁾	3,15	2014	—	31-X-2019	31-X	31-X
IT0004906308	Banca IMI 2013-2019 Tasso Misto Cap&Floor ³⁾	0,61	2013	—	31-V-2019	31-II; 31-V; 31-VIII; 31-XI	31-V
IT0004966229	Banca IMI 2013-2020 Collezione Opportunita USD ⁴⁾	1,88	2013	—	18-X-2020	18-X	18-X
IT0004990310	Banca IMI 2014-2019 3,55% NOK	3,55	2014	—	28-I-2019	28-I	28-I
IT0005026825	Banca IMI 2014-2019 4,2% AUD	4,20	2014	—	17-VI-2019	17-VI	17-VI
IT0004990161	Banca IMI 2014-2019 5,2% AUD	5,20	2014	—	28-I-2019	28-I; 28-VII	28-I
IT0005045247	Banca IMI 2014-2019 5,2% NZD	5,20	2014	—	08-IX-2019	08-IX	08-IX
IT0005001521	Banca IMI 2014-2019 Collezione Tasso Misto Serie I NZD ⁵⁾	2,72	2014	—	13-III-2019	13-III	13-III
IT0005001422	Banca IMI 2014-2019 Collezione Tasso Misto Serie I USD ⁶⁾	1,33	2014	—	13-III-2019	13-III	13-III
IT0005045221	Banca IMI 2014-2020 4,3% AUD	4,30	2014	—	08-IX-2020	08-IX	08-IX
IT0005038630	Banca Imi 2014-2021 1,6% Onestep BancoPosta ⁷⁾	1,60	2014	—	22-IX-2021	22-IX	22-IX
IT0005068116	Banca IMI 2014-2021 3% USD	3,00	2014	—	27-XI-2021	27-XI	27-XI
IT0005075509	Banca IMI 2015-2020 4,9% NZD	4,90	2015	—	22-I-2020	22-I	22-I
IT0005075517	Banca IMI 2015-2020 8% TRY	8,00	2015	—	22-I-2020	22-I	22-I
XS1251080831	Banca Imi 2015-2021 4,35% AUD	4,35	2015	—	26-VI-2021	26-VI	26-VI
XS1251080088	Banca Imi 2015-2022 3,5% USD	3,50	2015	—	26-VI-2022	26-VI	26-VI
IT0005114357	Banca IMI 2015-2022 Collezione Tasso Misto Serie I GBP ⁸⁾	0,81	2015	—	14-V-2022	14-V	14-V
IT0005114365	Banca IMI 2015-2022 Collezione Tasso Misto serie II USD ⁹⁾	1,68	2015	—	14-V-2022	14-V	14-V
XS1435073512	Banca IMI 2016-2018 8,5% Collezione Tasso Fisso Opera II RUB	8,50	2016	—	06-VII-2018	06-VII	06-VII

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

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
CAD 350.000	CAD 8.720	CAD 350.000	CAD 2.000	99,84	—
209.526	8.979	209.526	1000	100,00	—
USD 300.000	USD 30.876	USD 300.000	USD 2.000	99,20	—
200.869	10.911	200.869	1000	100,00	—
178.374	24.104	178.374	1000	100,00	—
USD 350.000	USD 84.134	USD 350.000	USD 2.000	99,94	—
NOK 1.950.000	NOK 27.885	NOK 1.950.000	NOK 15.000	99,74	—
AUD 370.000	AUD 21.648	AUD 370.000	AUD 2.000	99,66	—
AUD 400.000	AUD 24.140	AUD 400.000	AUD 2.000	99,74	—
NZD 350.000	NZD 34.180	NZD 350.000	NZD 2.000	99,63	—
NZD 350.000	NZD 11.645	NZD 350.000	NZD 2.500	99,83	—
USD 350.000	USD 27.884	USD 350.000	USD 2.000	99,85	—
AUD 350.000	AUD 53.766	AUD 350.000	AUD 2.000	99,64	—
7.359	543	7.359	1000	100,00	—
USD 300.000	USD 34.554	USD 300.000	USD 2.000	100,00	—
NZD 350.000	NZD 30.882	NZD 350.000	NZD 2.000	99,55	—
TRY 700.000	TRY 30.864	TRY 700.000	TRY 4.000	99,79	—
AUD 350.000	AUD 26.496	AUD 350.000	AUD 2.000	99,80	—
USD 280.000	USD 28.410	USD 280.000	USD 2.000	99,80	—
GBP 180.000	GBP 8.265	GBP 180.000	GBP 1.000	99,63	—
USD 260.000	USD 16.698	USD 260.000	USD 2.000	99,66	—
RUB 18.000.000	RUB 6.055.700	RUB 18.000.000	RUB 100.000	98,68	—

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

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
XS1435073785	Banca IMI 2016-2018 9,15% Collezione Tasso Fisso Opera V	9,15	2016	—	06-VII-2018	06-VII	06-VII
XS1522284659	Banca IMI 2016-2021 3,9% Collezione Opera VI AUD	3,90	2016	—	23-XI-2021	23-XI	23-XI
XS1522284576	Banca IMI 2016-2022 Collezione Tasso Misto serie II GBP ¹⁾	3,00	2016	—	23-XI-2022	23-XI	23-XI
XS1490786735	Banca IMI 2016-2022 Collezione Tasso Misto Serie V USD ²⁾	3,60	2016	—	28-IX-2022	28-IX	28-IX
XS1341083639	Banca IMI 2016-2023 Collezione Tasso Misto serie III USD ³⁾	4,50	2016	—	26-I-2023	26-I	26-I
XS1378969072	Banca IMI 2016-2024 Collezione Tasso Misto Serie IV USD ⁴⁾	1,00	2016	—	10-V-2024	10-II; 10-V; 10-VIII; 10-XI	10-V
XS1341083555	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto serie I ⁵⁾	3,10	2016	—	26-I-2026	26-I	26-I
XS1379091546	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto Serie II	2,20	2016	—	10-V-2026	10-II; 10-V; 10-VIII; 10-XI	10-V
XS1490787113	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto Serie III ⁶⁾	3,00	2016	—	28-IX-2026	28-IX	28-IX
XS1575872855	Banca IMI 2017-2019 11% Opera VI TRY ⁷⁾	11,00	2017	—	13-III-2019	13-III	13-III
XS1555142568	Banca IMI 2017-2023 Collezione Tasso Misto Serie VI USD	3,75	2017	—	25-I-2023	25-I	25-I
XS1608207640	Banca IMI 2017-2025 Collezione Tasso Misto serie VII USD ⁸⁾	4,00	2017	—	17-V-2025	17-V	17-V
XS1551929760	Banca IMI 2017-2027 Collezione Tasso Misto Serie IV ⁹⁾	2,70	2017	—	25-I-2027	25-I	25-I
XS1608207566	Banca IMI 2017-2027 Collezione Tasso Misto serie V ¹⁰⁾	3,40	2017	—	17-V-2027	17-V	17-V
XS1575872699	Banca IMI 2017-2021 4% Opera II NZD	4,00	2017	—	13-III-2021	13-III	13-III
XS0238916620	Banca Monte dei Paschi di Siena 2005-2018 Tasso Variabile	0,25	2005	—	15-I-2018	15-I; 15-IV; 15-VII; 15-X	15-I
XS0503326083	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5%	5,00	2010	—	21-IV-2020	21-IV	21-IV
XS0540544912	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5,6%	5,60	2010	—	09-IX-2020	09-IX	09-IX
IT0004771710	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 StepByStep BancoPosta ¹¹⁾	5,90	2011	—	30-XI-2017	30-XI	30-XI

1) Cedole fisse in pagamento fino al XI-2019 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al IX-2018 pari al 3,6%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 4,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al V-2019 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 3,1%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al IX-2018 pari al 3%.

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
TRY 800.000	TRY 27.435	TRY 800.000	TRY 5.000	99,00	—
AUD 400.000	AUD 41.802	AUD 400.000	AUD 2.000	99,62	—
GBP 260.000	GBP 12.893	GBP 260.000	GBP 1.000	99,70	—
USD 300.000	USD 64.750	USD 300.000	USD 2.000	99,28	—
USD 260.000	USD 39.660	USD 260.000	USD 2.000	98,34	—
USD 340.000	USD 67.542	USD 340.000	USD 2.000	99,50	—
500.000	76.960	500.000	1000	99,22	—
500.000	73.348	500.000	1000	99,42	—
300.000	213.355	300.000	1000	99,15	—
TRY 800.000	TRY 29.040	TRY 800.000	TRY 5.000	98,06	—
USD 300.000	USD 54.030	USD 300.000	USD 2.000	99,55	—
USD 300.000	USD 45.074	USD 300.000	USD 2.000	99,56	—
300.000	64.280	300.000	1000	99,54	—
300.000	35.710	300.000	1000	99,47	—
NZD 300.000	NZD 18.704	NZD 300.000	NZD 2.000	99,71	—
104.050	750	104.050	50000	99,36	—
500.000	40.350	500.000	50000	99,01	—
500.000	28.300	500.000	50000	99,01	—
434.414	71.163	434.414	1000	100,00	—

Successivamente cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al I-2020 pari al 3,75%. Successivamente cedole indicizzate. - 8) Cedole fisse in pagamento fino al V-2020 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 9) Cedole fisse in pagamento fino al I-2020 pari al 2,70%. Successivamente cedole indicizzate. - 10) Cedole fisse in pagamento fino al V-2018 pari al 3,40%. Successivamente cedole indicizzate. - 11) Cedole fisse a crescere pari al 5,1%, 5,3%, 5,5%, 5,7%, 5,9% e 6,1% annuo.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0004739576	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor BancoPosta ¹⁾	4,40	2011	—	29-IX-2017	29-III; 29-IX	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 ²⁾	4,60	2011	—	27-X-2017	27-IV; 27-X	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 ³⁾	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 ⁴⁾	4,00	2011	—	21-VII-2017	21-I; 21-VII	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	—
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-IV; 30-VII; 30-X	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	—	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	—	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	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 5,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 5,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) 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 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
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.
XS0236480322	Banca Monte dei Paschi di Siena 2005-2017 Tasso Variabile	0,27	2014	—	30-XI-2017	30-II; 30-V; 30-VIII; 30-XI	30-XI	369.000	14.450	369.000	50000	99,68	—
IT0001302733	Banca Monte dei Paschi di Siena 1999-2029 Tasso Misto 4A	—	1999	—	01-II-2029	01-II	01-II	39.318	6.376	100.000	1000	100,00	—
IT0001308508	Banca Monte dei Paschi di Siena 1999-2029 Tasso Misto 8A	—	1999	—	15-II-2029	15-II	15-II	34.484	9.385	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-IV; 15-VII; 15-X	15-I	104.050	3.350	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	20.600	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	24.200	500.000	50000	99,01	—
IT0004771710	Banca Monte dei Paschi di Siena 2011-2017 StepByStep BancoPosta ¹⁾	6,10	2011	—	30-XI-2017	30-XI	30-XI	434.414	55.727	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	29-IX	410.000	59.672	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	27-X	446.932	48.547	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	4.700	1.000.000	1000	99,46	—
XS1205644047	Banca Popolare di Vicenza 2,75%	2,75	2015	—	20-III-2020	20-III	20-III	750.000	50.500	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	55.300	400.000	1000	99,46	—
IT0005238859	Banca Popolare di Vicenza 2017-2020 0,50%	0,50	2017	—	03-II-2020	03-II; 03-VIII	03-II	3.000.000	6.800	3.000.000	100000	100,00	—
XS0555834984	Banco BPM 2010-2020 6%	6,00	2010	—	05-XI-2020	05-XI	05-XI	1.000.000	41.200	1.000.000	1000	99,65	—
XS0632503412	Banco BPM 2011-2021 6,375%	6,38	2011	—	31-V-2021	31-V	31-V	660.693	22.750	660.693	1000	99,26	—
XS0597182665	Banco BPM 2011-2021 7,125%	7,13	2011	—	01-III-2021	01-III	01-III	400.000	20.300	400.000	1000	99,60	—
XS1070681397	Banco BPM 2014-2018 2,375%	2,38	2014	—	22-I-2018	22-I	22-I	750.000	13.100	750.000	1000	99,69	—
XS1044894944	Banco BPM 2014-2019 3,5%	3,50	2014	—	14-III-2019	14-III	14-III	1.250.000	19.100	1.250.000	1000	99,64	—
XS1024830819	Banco BPM 2014-2019 4,25%	4,25	2014	—	30-I-2019	30-I	30-I	500.000	4.500	500.000	100000	99,66	—

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. -

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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 BPM 2015-2018 2,625%	2,63	2015	—	21-IX-2018	21-IX	21-IX	500.000	8.300	500.000	1000	99,82	—
XS1266866927	Banco BPM 2015-2020 2,75%	2,75	2015	—	27-VII-2020	27-VII	27-VII	1.000.000	24.100	1.000.000	1000	99,55	—
IT0004723893	Banco Popolare 2011-2017 Tasso Misto Cap&Floor Banco Posta Serie 2 ¹⁾	4,00	2011	—	21-VII-2017	21-I; 21-VII	21-VII	548.202	22.077	548.202	1000	100,00	—
IT0005120313	Banco Popolare 2015-2022 Tier2 Tasso Variabile Callable	1,01	2015	—	30-VII-2022	30-I; 30-IV; 30-VII; 30-X	30-VII	499.930	211.021	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	—	1998	—	04-XI-2018	04-XI	04-XI	94.253	18.541	232.405	5000000	100,00	—
IT0001304341	BIM-IMI 1999-2024 Fixed & Zero con Premio Fisso al Rimborso	—	1999	—	01-II-2024	01-II	01-II	25.710	2.628	210.000	1000	100,00	—
XS1401125346	Buzzi Unicem 2016-2023 2,125% Callable	2,13	2016	—	28-IV-2023	28-IV	28-IV	500.000	11.700	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	3.100	400.000	1000	99,07	—
XS1300465926	Campari 2015-2020 2,75%	2,75	2015	—	30-IX-2020	30-IX	30-IX	600.000	3.400	600.000	1000	99,72	—
IT0005025389	CDP 2014-2021 2,75%	2,75	2014	—	31-V-2021	31-V	31-V	750.000	1.100	750.000	1000	99,80	—
IT0005090995	CDP 2015-2022 Tasso Misto ²⁾	0,17	2015	—	20-III-2022	20-III; 20-VI; 20-IX; 20-XII	20-III	1.500.000	434.378	1.500.000	1000	100,00	—
IT0005105488	CDP 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	09-IV-2025	09-IV	09-IV	750.000	3.700	750.000	100000	99,89	—
IT0001267381	Centrobanca 1998-2018 Reverse Floater Capped	5,50	1998	—	20-X-2018	20-X	20-X	116.765	22.661	165.266	0,01	100,00	—
IT0001197083	Centrobanca 1998-2018 Zero Coupon	—	1998	—	30-I-2018	—	30-I	173.800	16.237	413.165	5000000	31,76	—
IT0001312708	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Eurostability Bond	—	1999	—	16-III-2019	16-III	16-III	55.250	4.576	60.000	1000	100,00	—
IT0001300992	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro a 10 Anni	0,46	1999	—	22-I-2019	22-I	22-I	116.332	24.523	170.000	1000	100,00	—
XS1088811432	CMC di Ravenna 2014-2021 7,5%	7,50	2014	—	01-VIII-2021	01-II; 01-VIII	01-VIII	284.650	7.700	284.650	100000	100,00	—
IT0004781016	Credem 2011-2017 7,05% Amortizing	7,05	2011	23-XII-2013	23-XII-2017	23-III; 23-VI; 23-IX; 23-XII	23-XII	10.000	1.801	40.000	800	100,00	—
IT0004870926	Credem 2012-2018 4,7% Amortizing Callable	4,70	2012	28-XII-2013	28-XII-2018	28-XII	28-XII	25.725	3.460	200.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato con preavviso di almeno 15 giorni.
IT0004819006	Credem 2012-2018 Tasso Misto Amortizing ³⁾	1,03	2012	15-VI-2013	15-VI-2018	15-III; 15-VI; 15-IX; 15-XII	15-VI	7.677	1.837	80.000	600	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 4,85%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari all'1,75%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2013 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0004803158	Credem 2012-2018 Tasso Misto Amortizing ¹⁾	0,92	2012	30-III-2013	30-III-2018	30-III; 30-VI; 30-IX; 30-XII	30-III	4.305	989	40.000	800	100,00	—
IT0001264792	Crediop 1998-2018 T.F./Capped Reverse Floater	5,50	1998	—	15-X-2018	15-X	15-X	143.442	33.064	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	15.622	61.975	0,01	100,00	—
IT0001317707	Crediop 1999-2019 Step-Down Lifestyle Accrued Interest	—	1999	—	29-III-2019	29-III	29-III	35.671	8.233	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	15.704	100.000	1000	100,00	—
IT0001308607	Crediop 1999-2024 Step-Down	—	1999	—	26-II-2024	26-II	26-II	53.695	6.327	80.000	1000	100,00	—
XS0550715600	Dexia Crediop 2010-2018 4,25% Trasformabile ²⁾	0,09	2010	—	22-X-2018	22-X	22-X	250.000	8.213	250.000	1000	100,00	—
XS0557268173	Dexia Crediop 2010-2020 Serie Speciale N.3 Reverse Floater ³⁾	5,56	2010	—	08-XI-2020	08-XI	08-XI	250.000	1.463	250.000	1000	100,00	—
IT0004650781	Dexia Crediop 2010-2020 Zero Coupon	—	2010	—	22-X-2020	—	22-X	250.000	954	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	914	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	3.748	3.000.000	1000	100,00	—
IT0005030306	E.S.TR.A. 2014-2019 5%	5,00	2014	—	14-VII-2019	14-VII	14-VII	50.000	2.800	50.000	100000	100,00	—
XS0170343247	Enel 2003-2018 4,75%	4,75	2003	—	12-VI-2018	12-VI	12-VI	750.000	5.504	750.000	1000	99,37	—
XS0306646042	Enel 2007-2027 5,625%	5,63	2014	—	21-VI-2027	21-VI	21-VI	850.000	1.550	850.000	1000	99,83	—
IT0004794142	Enel 2012-2018 4,875%	4,88	2012	—	20-II-2018	20-II	20-II	2.500.000	37.708	2.500.000	1000	99,95	—
IT0004794159	Enel 2012-2018 Tasso Variabile	1,45	2012	—	20-II-2018	20-II; 20-VIII	20-II	500.000	10.499	500.000	1000	100,00	—
IT0005204539	Enertronica 2016-2018 5%	5,00	2016	—	05-VIII-2018	05-II; 05-VIII	05-VIII	7.814	1.636	7.814	5400	100,00	—
XS0451457435	Eni 2009-2019 4,125%	4,13	2009	—	16-IX-2019	16-IX	16-IX	1.500.000	1.150	1.500.000	50000	99,43	—
XS0521000975	Eni 2010-2020 4%	4,00	2010	—	29-VI-2020	29-VI	29-VI	1.000.000	900	1.000.000	50000	99,83	—
IT0004760655	Eni 2011-2017 4,875%	4,88	2011	—	11-X-2017	11-X	11-X	1.109.565	18.731	1.109.565	1000	99,71	—
IT0004760648	Eni 2011-2017 Tasso Variabile	1,30	2011	—	11-X-2017	11-IV; 11-X	11-X	215.011	3.078	215.011	1000	100,00	—
XS0951565091	Eni 2013-2023 3,25%	3,25	2013	—	10-VII-2023	10-VII	10-VII	1.000.000	2.100	1.000.000	100000	98,81	—

1) 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 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS0970852348	Eni 2013-2025 3,75%	3,75	2013	—	12-IX-2025	12-IX	12-IX	900.000	900	900.000	1000	99,49	—
XS1292988984	Eni 2015-2024 1,75%	1,75	2015	—	18-I-2024	18-I	18-I	750.000	1.000	750.000	1000	99,19	—
XS1180451657	Eni 2015-2026 1,5%	1,50	2015	—	02-II-2026	02-II	02-II	1.000.000	2.800	1.000.000	1000	99,27	—
XS1493322355	Eni 2016-2024 0,625%	0,63	2016	—	19-IX-2024	19-IX	19-IX	900.000	1.700	900.000	1000	99,23	—
XS1493328477	Eni 2016-2028 1,125%	1,13	2016	—	19-IX-2028	19-IX	19-IX	600.000	3.500	600.000	100000	100,00	—
XS1412711217	Eni 2016-2028 1,625%	1,63	2016	—	17-V-2028	17-V	17-V	800.000	800	800.000	1000	98,73	—
XS1551068676	Eni 2017-2027 1,5%	1,50	2017	—	17-I-2027	17-I	17-I	750.000	3.300	750.000	1000	100,00	—
IT0005104713	Ferrarini 2015-2020 6,375%	6,38	2015	—	15-IV-2020	15-IV; 15-X	15-IV	30.000	5.700	30.000	100000	100,00	—
XS1004118904	Ferrovie dello Stato 2013-2021 3,5%	3,50	2014	—	13-XII-2021	13-XII	13-XII	600.000	900	600.000	1000	99,50	—
IT0005172181	Finanziaria Internazionale Holding 2016-2017 4% Callable	4,00	2016	—	17-IX-2017	17-III; 17-IX	17-IX	40.000	1.100	40.000	50000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato, con preavviso di almeno 30 giorni, in coincidenza di ciascuna cedola.
XS0471071133	Hera 2009-2019 4,5% Callable	4,50	2009	—	03-XII-2019	03-XII	03-XII	500.000	700	500.000	1000	99,28	Facoltà di rimborso anticipato, anche parziale, in ogni momento.
IT0005238727	I.Co.P 2017-2024 6% Amortizing	6,00	2017	—	31-I-2024	31-I; 31-VII	31-I	7.000	1.100	7.000	100000	100,00	—
XS1569103259	Iccrea Banca 2017-2020 1,5%	1,50	2017	—	21-II-2020	21-II	21-II	600.000	7.600	600.000	1000	99,93	—
IT0005074577	Intek Group 2015-2020 5% Callable	5,00	2015	—	20-II-2020	20-II	20-II	101.704	22.260	101.704	21,6	100,00	—
IT0006526302	Inter-American Development Bank 1998-2018 Reset	7,50	1998	—	24-XII-2018	24-XII	24-XII	77.469	803	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	1.410	129.114	5000000	100,00	—
IT0001311247	Interbanca 1999-2019 Upside Protected	—	1999	—	01-III-2019	01-III	01-III	20.277	2.058	75.000	1000	100,00	—
IT0001304010	Interbanca 1999-2021 Coupon Reset	—	1999	—	16-II-2021	16-II	16-II	41.990	5.766	80.000	1000	100,00	—
XS0555977312	Intesa Sanpaolo 2010-2018 4%	4,00	2010	—	08-XI-2018	08-XI	08-XI	1.250.000	4.500	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	23.400	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	6.100	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	15.200	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	3.500	1.710.906	1000	99,96	—
XS0842828120	Intesa Sanpaolo 2012-2019 4,375%	4,38	2012	—	15-X-2019	15-X	15-X	1.250.000	1.800	1.250.000	100000	99,48	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS0986194883	Intesa Sanpaolo 2013-2023 4%	4,00	2013	—	30-X-2023	30-X	30-X	1.000.000	4.600	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	10.900	1.445.656	1000	99,12	—
XS1057822766	Intesa Sanpaolo 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,27	2014	—	17-IV-2019	17-I; 17-IV; 17-VII; 17-X	17-IV	1.000.000	1.000	1.000.000	1000	99,76	—
XS1018032950	Intesa Sanpaolo 2014-2022 3,5%	3,50	2014	—	17-I-2022	17-I	17-I	750.000	1.600	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	67.500	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	1.000	1.250.000	1000	99,45	—
XS1246144650	Intesa Sanpaolo 2015-2020 Tasso Variabile	0,26	2015	—	15-VI-2020	15-III; 15-VI; 15-IX; 15-XII	15-VI	1.000.000	2.200	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	6.800	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	50.000	500.000	1000	100,00	—
XS1551306951	Intesa Sanpaolo 2017-2024 1,375%	1,38	2017	—	18-I-2024	18-I	18-I	1.000.000	4.600	1.000.000	1000	99,31	—
IT0005010480	Ipi 2014-2021 7% Amortizing	7,00	2014	10-IV-2016	10-IV-2021	10-IV; 10-X	10-IV	18.000	1.590	20.000	100000	100,00	Rimborso in 5 rate annuali esigibili a partire dal 10-IV-2014.
XS1314238459	Iren 2015-2022 2,75%	2,75	2015	—	02-XI-2022	02-XI	02-XI	500.000	1.100	500.000	1000	99,40	—
XS1498549325	Isolante K-Flex 2016-2023 4,25%	4,25	2016	—	07-X-2023	07-X	07-X	180.000	11.000	180.000	1000	100,00	—
IT0001086658	Istituto Bancario San Paolo di Torino 1997-2022 Zero Coupon	—	1997	—	30-I-2022	—	30-I	167.848	41.169	167.848	0,01	17,20	—
XS1578294081	Italgas 2017-2024 1,125%	1,13	2017	—	14-III-2024	14-III	14-III	650.000	3.000	650.000	1000	99,71	—
XS1551917591	Italgas 2017-2027 1,625%	1,63	2017	—	19-I-2027	19-I	19-I	750.000	800	750.000	1000	99,17	—
IT0005107237	Landi Renzo 2015-2020 6,1% Amortizing Callable	6,50	2015	—	30-XII-2019	30-VI; 30-XII	—	25.500	940	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 2003-2018 5,75%	5,75	2003	—	12-XII-2018	12-XII	12-XII	500.000	6.415	500.000	1000	99,56	—
XS0215093534	Leonardo 2005-2025 4,875%	4,88	2014	—	24-III-2025	24-III	24-III	500.000	12.350	500.000	1000	99,27	—
XS0458887030	Leonardo 2009-2022 5,25%	5,25	2009	—	21-I-2022	21-I	21-I	800.000	9.250	800.000	1000	99,19	—
XS0861828407	Leonardo 2012-2017 4,375%	4,38	2012	—	05-XII-2017	05-XII	05-XII	600.000	3.100	600.000	1000	99,42	—
XS0999654873	Leonardo 2013-2021 4,5%	4,50	2013	—	19-I-2021	19-I	19-I	700.000	10.500	700.000	1000	98,51	—
XS1083010311	L'Isolante K-Flex 2014-2020 6%	6,00	2014	—	01-VII-2020	01-VII	01-VII	100.000	3.600	100.000	1000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS0758640279	Luxottica Group 2012-2019 3,625%	3,63	2012	—	19-III-2019	19-III	19-III	500.000	1.000	500.000	1000	99,45	—
XS0808635352	Manutencoop Facility Management 2013-2020 8,5%	8,58	2013	—	01-VIII-2020	01-II; 01-VIII	01-VIII	411.600	14.900	424.000	1000	98,71	—
XS0991759076	Marcolin 2013-2019 8,5%	8,50	2013	—	15-XI-2019	15-V; 15-XI	15-XI	188.100	6.800	188.100	1000	100,00	—
XS1562036704	Marcolin 2017-2023 Tasso Variabile Callable	1,03	2017	—	15-II-2023	15-II; 15-V; 15-VIII; 15-XI	15-II	249.585	2.800	249.585	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato dal 15-II-2018, con preavviso di almeno 8 giorni, per un importo del 100% del valore nominale.
IT0001339586	Mediobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro 30 Anni	0,90	1999	—	25-VI-2019	25-VI	25-VI	44.566	6.507	75.000	1000	100,00	—
XS0556045259	Mediobanca 2010-2017 Fixed-Floating Rate ¹⁾	0,02	2010	—	07-XII-2017	07-XII	07-XII	8.357	2.223	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	76.850	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	615.600	129.051	750.000	1000	100,00	—
IT0004783046	Mediobanca 2011-2017 Atto Unico Zero Coupon	—	2011	—	12-XII-2017	—	12-XII	125.000	33.361	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-VI; 13-IX; 13-XII	13-VI	396.957	132.946	500.000	1000	100,00	—
XS0835346056	Mediobanca 2012-2017 Index Linked	—	2012	21-XII-2017	21-XII-2017	—	21-XII	6.087	538	6.087	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
XS0821919171	Mediobanca 2012-2017 Indicizzato EURO STOXX 50	5,75	2012	—	15-X-2017	15-X	—	7.667	769	7.667	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
XS0820711132	Mediobanca 2012-2017 Inflation Linked ²⁾	1,61	2012	—	16-X-2017	16-X	16-X	14.200	1.564	14.200	1000	100,00	—
IT0004839020	Mediobanca 2012-2017 Tasso Misto ³⁾	1,92	2012	—	10-VIII-2017	10-VIII	10-VIII	12.415	1.937	22.064	1000	100,00	—
XS0835345082	Mediobanca 2012-2017 Tasso Misto ⁴⁾	1,90	2012	—	21-XI-2017	21-XI	21-XI	26.126	3.787	48.363	1000	100,00	—
IT0004965577	Mediobanca 2013-2018 3,2%	3,20	2014	—	04-XII-2018	04-XII	04-XII	20.830	3.985	29.889	1000	100,00	—
IT0004890361	Mediobanca 2013-2018 Fix to Floater ⁵⁾	0,25	2013	—	28-II-2018	31-II; 31-V; 31-VIII; 31-XI	28-II	6.761	1.986	6.761	1000	100,00	—
IT0004884778	Mediobanca 2013-2018 Indicizzato EURO STOXX 50	—	2013	—	25-II-2013	—	—	8.025	632	8.025	1000	100,00	Corresponsione di un premio indicizzato all'atto del rimborso.
IT0004931090	Mediobanca 2013-2018 Opzione digitale EURO STOXX 50	4,00	2013	—	24-VII-2018	24-VII	24-VII	7.576	855	7.576	1000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 2,2%. 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 2015 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
IT0004884794	Mediobanca 2013-2018 Tasso Misto ¹⁾	0,63	2013	—	25-II-2018	25-II	—
IT0004909682	Mediobanca 2013-2018 Tasso Misto ²⁾	5,00	2013	—	18-VI-2018	18-VI	18-VI
IT0004941875	Mediobanca 2013-2019 Inflazione Italiana ³⁾	2,11	2013	—	11-I-2019	11-I; 11-VII	11-I
IT0004872435	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto ⁴⁾	1,77	2013	—	16-I-2019	16-I	16-I
IT0004892425	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto ⁵⁾	1,17	2013	—	02-IV-2019	02-IV	02-IV
IT0004899511	Mediobanca 2013-2019 Tasso Misto	1,07	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-VI; 18-IX; 18-XII	18-VI
IT0004931082	Mediobanca 2013-2020 Tasso Variabile Cap&Floor	0,76	2013	—	24-VII-2023	24-I; 24-IV; 24-VII; 24-X	24-VII
IT0004936149	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50 ⁶⁾	5,75	2013	—	29-VIII-2021	29-VIII	29-VIII
IT0004952401	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50 ⁷⁾	4,25	2013	—	25-IX-2021	25-IX	25-IX
IT0004958069	Mediobanca 2013-2021 Opzioni digitali EURO STOXX 50 ⁸⁾	5,25	2013	—	30-X-2021	30-X	30-X
IT0004924004	Mediobanca 2013-2021 Sintesi Tasso Misto ⁹⁾	6,00	2013	—	21-XI-2021	21-V; 21-XI	21-XI
IT0004924046	Mediobanca 2013-2021 Sintesi Tasso Misto USD ¹⁰⁾	6,50	2013	—	21-XI-2021	21-V; 21-XI	21-XI
IT0004917842	Mediobanca 2013-2023 5,75%	5,75	2013	—	18-IV-2023	18-IV	18-IV
IT0004958051	Mediobanca 2013-2023 Tasso Misto con Cap&Floor ¹¹⁾	0,78	2013	—	30-X-2023	30-I; 30-IV; 30-VII; 30-X	30-X
IT0004967201	Mediobanca 2013-2023 Tasso Misto con Cap&Floor ¹²⁾	0,76	2014	—	04-XII-2023	04-III; 04-VI; 04-IX; 04-XII	04-XII
IT0004952336	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile Cap&Floor	0,76	2013	—	25-IX-2023	25-III; 25-VI; 25-IX; 25-XII	25-IX
IT0004935976	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile con Cap&Floor	0,77	2013	—	29-VIII-2023	29-II; 29-V; 29-VIII; 29-XI	29-VIII
XS1046272420	Mediobanca 2014-2019 2,25%	2,25	2014	—	18-III-2019	18-III	18-III
IT0005056483	Mediobanca 2014-2019 3% USD	3,00	2014	—	02-X-2019	02-X	02-X
XS0993892909	Mediobanca 2014-2021 Fixed to Floating with Cap&Floor ¹³⁾	0,57	2014	—	22-I-2021	22-I; 22-IV; 22-VII; 22-X	22-I

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

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
33.004	5.613	36.159	1000	100,00	—
26.390	8.231	26.390	1000	100,00	—
50.000	9.810	200.000	1000	99,50	—
34.261	11.276	50.368	1000	100,00	—
40.039	11.723	40.039	1000	100,00	—
25.439	6.276	25.439	1000	100,00	—
12.918	1.605	19.006	1000	100,00	—
26.655	7.378	30.531	1000	100,00	—
23.224	1.458	23.224	1000	100,00	—
9.600	1.920	9.600	1000	100,00	—
11.300	2.661	11.300	1000	100,00	—
23.000	3.917	40.000	1000	100,00	—
USD 14.000	USD 1.902	USD 20.000	USD 1.000	100,00	—
496.563	161.941	500.000	1000	100,00	—
64.964	13.745	77.975	1000	100,00	—
45.767	6.634	52.337	1000	100,00	—
8.751	2.251	11.214	1000	100,00	—
17.960	4.790	21.311	1000	100,00	—
750.000	1.500	750.000	1000	99,89	—
USD 400.000	USD 124.600	USD 400.000	USD 2.000	100,00	—
8.110	1.973	8.110	1000	100,00	—

al 4% per il primo anno e al 4,5% per il secondo anno. Successivamente cedole indicizzate. - 9) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - 10) Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 11) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 12) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 13) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
IT0005013054	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50 ¹⁾	4,00	2014	—	28-V-2021	28-V	28-V
IT0005021602	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50 ²⁾	4,00	2014	—	30-VI-2021	30-VI	30-VI
IT0005026999	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	—	2014	—	13-VIII-2021	13-VIII	13-VIII
IT0005044711	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	—	2014	—	15-X-2021	15-X	15-X
IT0005021586	Mediobanca 2014-2021 Tasso Misto con Cap ³⁾	0,17	2014	—	30-VI-2021	30-III; 30-VI; 30-IX; 30-XII	30-VI
IT0004981871	Mediobanca 2014-2022 3,2%	3,20	2014	—	26-II-2022	26-II	26-II
XS0993892735	Mediobanca 2014-2022 3,2%	3,20	2014	—	22-I-2022	22-I	22-I
IT0005004475	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto ⁴⁾	0,28	2014	—	19-V-2022	19-II; 19-V; 19-VIII; 19-XI	19-V
IT0004998172	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto ⁵⁾	0,30	2014	—	02-IV-2022	02-I; 02-IV; 02-VII; 02-X	02-IV
IT0004981889	Mediobanca 2014-2022 Tasso Misto con Cap e Floor ⁶⁾	0,65	2014	—	26-II-2022	26-II; 26-V; 26-VIII; 26-XI	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	0,48	2015	—	06-V-2020	06-II; 06-V; 06-VIII; 06-XI	06-V
IT0005143257	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile GBP	0,44	2015	—	12-XI-2020	12-II; 12-V; 12-VIII; 12-XI	12-XI
IT0005143240	Mediobanca 2015-2020 Tasso Variabile USD	0,67	2015	—	12-XI-2020	12-II; 12-V; 12-VIII; 12-XI	12-XI
IT0005122830	Mediobanca 2015-2022 Opzioni digitali ⁷⁾	1,80	2015	—	16-IX-2022	16-IX	16-IX
IT0005127151	Mediobanca 2015-2022 Opzioni digitali	—	2015	—	28-X-2022	28-X	28-X
IT0005118796	Mediobanca 2015-2025 2,75% Callable	2,75	2015	—	12-VI-2025	12-VI	12-VI

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
9.099	2.174	9.099	1000	100,00	—
8.816	1.283	8.816	1000	100,00	—
6.220	814	6.220	1000	100,00	—
5.911	1.182	5.911	1000	100,00	—
8.528	3.906	8.528	1000	100,00	—
42.183	7.826	48.756	1000	100,00	—
38.042	5.985	46.371	1000	100,00	—
10.251	1.834	10.251	1000	100,00	—
8.416	2.219	8.416	1000	100,00	—
12.588	2.434	12.588	1000	100,00	—
USD 15.344	USD 9.236	USD 15.344	USD 2.000	100,00	—
USD 12.516	USD 7.228	USD 12.516	USD 2.000	100,00	—
GBP 70.000	GBP 13.230	GBP 70.000	GBP 2.000	100,00	—
USD 100.000	USD 18.000	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
13.858	2.365	13.858	1000	100,00	—
5.083	877	5.083	1000	100,00	—
200.000	36.078	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.

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 3%. 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 al 2,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 2,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 2,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) 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 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0005127508	Mediobanca 2015-2025 Valore	0,76	2015	—	10-IX-2025	10-III; 10-VI; 10-IX; 10-XII	10-IX	500.000	214.033	500.000	1000	100,00	—
XS1346762641	Mediobanca 2016-2021 1,625%	1,63	2016	—	19-I-2021		19-I	600.000	1.600	600.000	1000	99,88	—
IT0005239261	Mediobanca 2017- 2023 Passo Sterlina Tasso Variabile GBP	0,46	2017	—	12-I-2023	12-I; 12-IV; 12-VII; 12-X	12-I	GBP 25.000	GBP 15.398	GBP 25.000	GBP 1.000	100,00	—
XS1551000364	Mediobanca 2017-2020 0,75%	0,75	2017	—	17-I-2020		17-I	750.000	2.100	750.000	1000	99,81	—
IT0005239253	Mediobanca 2017-2023 Passo Euro Tasso Variabile	0,25	2017	—	12-I-2023	12-I; 12-IV; 12-VII; 12-X	12-I	150.000	133.429	150.000	1000	100,00	—
IT0001278404	Mediocredito Centrale 1998-2018 Floored Top Side	0,38	1998	—	03-XII-2018	03-III; 03-VI; 03-IX; 03-XII	03-XII	42.105	6.485	51.646	0,01	100,00	—
IT0001287249	Mediocredito Centrale 1998-2018 Step-Down	—	1998	—	24-XII-2018		24-XII	42.982	7.656	77.468	0,01	100,00	—
IT0001203253	Mediocredito Centrale 1998-2028 Zero Coupon	—	1998	—	10-II-2028		10-II	256.356	37.295	309.874	0,01	17,52	—
IT0001306171	Mediocredito Centrale 1999-2019 Step-Down Zero Coupon	—	1999	—	18-II-2019		18-II	98.396	11.495	120.000	1000	100,00	—
IT0001271649	Mediocredito Lombardo 1998-2018 Reverse Floater Capped	5,50	1998	—	06-XI-2018		06-XI	246.653	45.352	284.051	0,01	100,00	—
IT0001205589	Mediocredito Lombardo 1998-2028 Zero Coupon	—	1998	—	18-II-2028		18-II	201.147	44.651	206.582	0,01	17,37	—
IT0001292850	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	0,50	1999	—	15-I-2019		15-I	191.106	44.820	300.000	1000	100,00	—
IT0001336368	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	0,55	1999	—	03-VI-2019		03-VI	70.000	15.794	70.000	1000	100,00	—
IT0001307286	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down Reverse Floater Capped	5,00	1999	—	18-II-2019		18-II	207.654	44.567	207.654	1000	100,00	—
IT0005105900	Micoperi 2015-2020 5,75% Amortizing	5,75	2015	—	29-IV-2020	29-I; 29-IV; 29-VII; 29-X	29-IV	31.500	740	35.000	100000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0004936289	Mittel 2013-2019 6% Callable	6,00	2013	—	12-VII-2019	12-I; 12-VII	12-VII	99.854	23.571	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.
IT0005216475	Net Insurance 2016-2026 7% Callable	7,00	2016	—	30-IX-2026	30-IX	30-IX	15.000	1.700	15.000	100000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato a partire dal 30-IX-2021, con preavviso fra i 30 e i 45 giorni lavorativi.
XS1074596344	Officine Maccaferri 2014-2021 5,75%	5,75	2014	—	01-VI-2021	01-VI; 01-XII	01-VI	187.500	11.300	197.500	1000	100,00	—
XS1214547777	Prismian 2015-2022 2,5%	2,50	2015	—	11-IV-2022	11-IV	11-IV	750.000	20.100	750.000	1000	99,00	—
XS1237519571	RAI 2015-2020 1,5%	1,50	2015	—	28-V-2020	28-V	28-V	350.000	1.300	350.000	1000	99,27	—
XS0956262892	Salini Impregilo 2013-2018 6,125%	6,13	2013	—	01-VIII-2018	01-VIII	01-VIII	400.000	2.800	400.000	1000	99,48	—
XS1435297202	Salini Impregilo 2016-2021 3,75% Callable	3,75	2016	—	24-VI-2021	24-VI	24-VI	428.264	35.800	428.264	1000	100,00	—
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	21.322	150.000	1000	100,00	—
XS1454976801	Schumann 2016-2022 Tasso Variabile	1,66	2016	—	31-VII-2022	31-I; 31-IV; 31-VII; 31-X	31-VII	324.370	1.700	324.370	1000	99,00	—
XS1454980159	Schumann 2016-2023 7%	7,00	2016	—	31-VII-2023	31-I; 31-VII	31-VII	395.370	3.900	395.370	1000	100,00	—
IT0005054173	Sipcam 2014-2019 6,5%	6,50	2014	—	30-IX-2019	30-III; 30-VI; 30-IX; 30-XII	30-IX	15.000	900	15.000	100000	100,00	—
XS0931919947	Sisal Holding 2013-2017 7,25%	7,25	2013	—	30-IX-2017	30-III; 30-IX	30-IX	271.335	1.300	271.335	1000	100,00	—
XS0853682069	Snam 2012-2020 3,5%	3,50	2012	—	13-II-2020	13-II	13-II	750.000	1.100	750.000	1000	99,65	—
XS0829190585	Snam 2012-2022 5,25%	5,25	2012	—	19-IX-2022	19-IX	19-IX	1.000.000	600	1.000.000	1000	99,44	—
XS1019326641	Snam 2014-2024 3,25%	3,25	2014	—	22-I-2024	22-I	22-I	600.000	1.200	600.000	1000	99,02	—
XS1555402145	Snam 2017-2025 1,25%	1,25	2017	—	25-I-2025	25-I	25-I	500.000	1.000	500.000	1000	99,49	—
IT0005215055	Soletto 2016-2022 6,5% Amortizing	6,50	2016	—	27-IX-2022	27-III; 27-IX	27-IX	5.000	800	5.000	100000	100,00	—
IT0005058372	TBS Group 2014-2019 6,5%	5,20	2014	—	31-X-2019	31-I; 31-IV; 31-VII; 31-X	31-X	15.000	1.300	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	3.700	1.250.000	100000	99,07	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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	97.900	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	12.850	1.250.000	50000	99,30	—
XS0630463965	Telecom Italia 2011-2018 4,75%	4,75	2011	—	25-V-2018	25-V	25-V	750.000	2.700	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	900	1.000.000	1000	99,69	—
XS0868458653	Telecom Italia 2012-2020 4%	4,00	2012	—	21-I-2020	21-I	21-I	1.000.000	6.500	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	3.700	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	6.900	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	18.300	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	15.800	750.000	1000	99,63	—
XS1497606365	Telecom Italia 2016-2025 3%	3,00	2016	—	30-IX-2025	30-IX	30-IX	1.000.000	71.100	1.000.000	1000	99,81	—
XS1419869885	Telecom Italia 2016-2026 3,625%	3,63	2016	—	25-V-2026	25-V	25-V	1.000.000	25.700	1.000.000	1000	100,00	—
XS1551678409	Telecom Italia 2017-2023 2,5%	2,50	2017	—	19-I-2023	19-I	19-I	1.000.000	10.900	1.000.000	1000	99,29	—
IT0005210973	Tenute Piccini S.r.l. 2016-2022 5,5% Amortizing	5,50	2016	—	04-VIII-2022	04-VIII	04-VIII	5.000	2.300	5.000	100000	100,00	Rimborso in 5 quote annuali di capitale a partire dal 4-VIII-2018.
IT0004991573	TerniEnergia 2014-2019 6,875%	6,88	2014	—	06-II-2019	06-II	06-II	25.000	2.000	25.000	50000	100,00	—
IT0005012247	Tesmec 2014-2021 6%	6,00	2014	—	10-IV-2021	10-IV	10-IV	15.000	3.200	15.000	100000	100,00	—
IT0005009524	TIP 2014-2020 4,75%	4,75	2014	—	14-IV-2020	14-IV	14-IV	100.000	37.034	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	9.600	50.000	100000	100,00	—
XS1086778641	Twin Set; Simona Barbieri 2014-2019 Tasso Variabile	1,39	2014	—	15-VII-2019	15-I; 15-IV; 15-VII; 15-X	15-VII	150.000	2.100	150.000	1000	99,00	—
IT0004457070	UBI Banca 2009-2019 Fixed to Euribor Linked	0,81	2009	—	13-III-2019	13-III; 13-IX	13-III	370.000	116.964	370.000	1000	100,00	—
IT0004497050	UBI Banca 2009-2019 Fixed-Floater	1,63	2009	—	30-VI-2019	30-VI; 30-XII	30-VI	365.000	112.643	365.000	1000	100,00	—
IT0004723489	UBI Banca 2011-2018 5,4% Amortizing	5,40	2011	—	30-VI-2018	30-VI; 30-XII	30-VI	80.000	38.879	400.000	1000	100,00	—
IT0004718489	UBI Banca 2011-2018 5,5% Amortizing	5,50	2011	—	16-VI-2018	16-VI; 16-XII	16-VI	80.000	31.564	400.000	1000	100,00	—
IT0004767742	UBI Banca 2011-2018 Subordinato Lower Tier II; Tasso Misto Welcome Edition ¹⁾	0,67	2011	—	18-XI-2018	18-II; 18-V; 18-VIII; 18-XI	18-XI	222.339	69.749	222.339	1000	100,00	—

¹⁾ Cedole fisse in pagamento fino al 2014 pari al 6,25%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0004842370	UBI Banca 2012-2019 6% Amortizing	6,00	2012	08-X-2015	08-X-2019	08-IV; 08-X	08-X	582.274	134.839	970.457	1000	100,00	—
IT0004841778	UBI Banca 2012-2019 Tasso Misto Welcome Edition ¹⁾	4,67	2012	—	08-X-2019	08-I; 08-IV; 08-VII; 08-X	08-X	200.000	50.365	200.000	1000	100,00	—
XS1033018158	UBI Banca 2014-2019 2,875%	2,88	2014	—	18-II-2019	18-II	18-II	1.000.000	900	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	42.400	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.
XS1580469895	UBI Banca 2017-2027 4,45% Callable	4,45	2017	—	15-IX-2027	15-IX	15-IX	500.000	12.900	500.000	1000	99,79	—
XS1041042828	UGF 2014-2021 4,375%	4,38	2014	—	05-III-2021	05-III	05-III	500.000	3.900	500.000	1000	99,37	—
XS1206977495	UGF 2015-2025 3%	3,00	2015	—	18-III-2025	18-III	18-III	1.000.000	90.100	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	2.850	1.000.000	1000	99,59	—
XS0367777884	UniCredit 2008-2018 6,7%	6,70	2014	—	05-VI-2018	05-VI	05-VI	835.303	4.700	835.303	1000	99,82	—
XS0618847775	UniCredit 2011-2021 6,125%	6,13	2011	—	19-IV-2021	19-IV	19-IV	750.000	14.800	750.000	1000	99,62	—
XS0863482336	UniCredit 2012-2018 3,375%	3,38	2012	—	11-I-2018	11-I	11-I	750.000	1.100	750.000	1000	99,69	—
IT0004825029	UniCredit 2012-2018 5,65%	5,65	2012	—	24-VIII-2018	24-VIII	24-VIII	547.108	30.731	547.108	1000	100,00	—
IT0004808421	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 5%	5,00	2012	—	21-V-2018	21-V	21-V	399.840	19.767	399.840	1000	100,00	—
IT0004787476	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 6,1%	6,10	2012	—	16-III-2018	16-III	16-III	249.990	11.764	249.990	1000	100,00	—
XS0849517650	UniCredit 2012-2022 6,95%	6,95	2012	—	31-X-2022	31-X	31-X	1.250.000	28.800	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	1.000	1.250.000	1000	99,61	—
XS1078760813	UniCredit 2014-2019 1,5%	1,50	2014	—	19-VI-2019	19-VI	19-VI	1.000.000	1.500	1.000.000	1000	99,50	—
IT0005022055	Unicredit 2014-2020 2,1% OneStep BancoPosta ²⁾	2,10	2014	—	31-VII-2020	31-VII	31-VII	50.000	6.810	50.000	10000	100,00	—
XS1014627571	UniCredit 2014-2021 3,25%	3,25	2014	—	14-I-2021	14-I	14-I	1.250.000	2.400	1.250.000	1000	99,43	—
XS1169707087	UniCredit 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,27	2015	—	19-II-2020	19-II; 19-V; 19-VIII; 19-XI	19-II	1.000.000	2.700	1.000.000	1000	99,75	—
XS1374865555	Unicredit 2016-2023 2%	2,00	2016	—	04-III-2023	04-III	04-III	1.000.000	5.600	1.000.000	1000	99,22	—
XS1508450688	UniCredit 2016-2026 2,125%	2,13	2016	—	24-X-2026	24-X	24-X	1.000.000	4.100	1.000.000	1000	99,64	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 7,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse pari al 3,3% annuo la prima cedola e 2,1% annuo le restanti cedole.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
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 ¹⁾	0,78	2016	—	11-IV-2026	11-I; 11-IV; 11-VII; 11-X	11-IV
XS1377769879	Unicredit Bank 2016-2026 Premiere Bond Fixed to Floater USD ²⁾	1,05	2016	—	11-IV-2026	11-I; 11-IV; 11-VII; 11-X	11-IV
XS1069508494	Veneto Banca 2014-2019 4%	4,00	2014	—	20-V-2019	20-V	20-V
IT0005239535	Veneto Banca 2017-2020 0,5%	0,50	2017	—	02-II-2020	02-II; 02-VIII	02-II
DI SOCIETÀ ESTERE							
NL0009287614	ABN AMRO Bank 2009-2019 4,6%	4,60	2009	—	11-XII-2019	11-III; 11-VI; 11-IX; 11-XII	11-XII
NL0009054907	ABN AMRO Bank 2009-2019 5,5%	5,50	2009	—	20-IV-2019	20-IV; 20-X	20-IV
NL0009062215	ABN AMRO Bank 2009-2019 Royal Fisso-Variabile ³⁾	0,42	2009	—	08-X-2019	08-I; 08-IV; 08-VII; 08-X	08-X
NL0009289339	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal 5,5% Inflazione ⁴⁾	2,08	2010	—	11-I-2020	11-I	11-I
NL0009289313	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal Euribor	2,11	2010	—	11-I-2020	11-I; 11-IV; 11-VII; 11-X	11-I
FR0011374099	Air France-KLM 2012-2018 6,25%	6,25	2012	—	18-I-2018	18-I	18-I
FR0011965177	Air France-KLM 2014-2021 3,875%	3,88	2014	—	18-VI-2021	18-VI	18-VI
FR0013212958	Air France-KLM 2016-2022 3,75% Callable	3,75	2016	—	12-X-2022	12-X	12-X
XS0830380639	Anglo American Capital 2012-2018 2,5%	2,50	2012	—	18-IX-2018	18-IX	18-IX
XS0764637194	Anglo American Capital 2012-2022 3,5%	3,50	2012	—	28-III-2022	28-III	28-III
XS0995040051	Anglo American Capital 2013-2020 2,875%	2,88	2013	—	20-XI-2020	20-XI	20-XI
XS0923361827	Anglo American Capital 2013-2021 2,5%	2,50	2013	—	29-IV-2021	29-IV	29-IV

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
750.000	35.000	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 998	GBP 50.000	GBP 1.000	100,00	—
USD 47.000	USD 25.809	USD 100.000	USD 1.000	100,00	—
500.000	59.000	500.000	1000	99,56	—
1.750.000	12.800	1.750.000	100000	100,00	—
67.962	6.532	100.000	1000	100,00	—
151.691	13.810	400.000	1000	100,00	—
209.298	28.129	500.000	1000	100,00	—
46.664	6.474	175.000	1000	100,00	—
83.683	13.234	300.000	1000	100,00	—
500.000	600	500.000	100000	99,45	—
600.000	12.400	600.000	100000	99,25	—
400.000	13.000	400.000	100000	100,00	L'emittente ha la facoltà di rimborsare in ogni momento il prestito con un preavviso di almeno 15 giorni, per l'intero ammontare, nel caso in cui l'ammontare in circolazione sia <20% dell'ammontare di emissione.
481.635	1.200	481.635	1000	99,86	—
750.000	800	750.000	1000	99,73	—
600.000	1.300	600.000	1000	99,40	—
750.000	1.300	750.000	1000	99,38	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al IV-2020 pari al 3,10%. Successivamente cedole indicizzate. - 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. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2011 pari al 5,50%, poi 1,60%. A partire dal 2014 eventuali interessi variabili aggiuntivi.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
XS1052677892	Anglo American Capital 2014-2023 3,25%	3,25	2014	—	03-IV-2023	03-IV	03-IV	750.000	4.600	750.000	1000	99,82	—	
US037833AK68	Apple 2013-2023 2,4% USD Callable	2,40	2013	—	03-V-2023	03-V; 03-XI	03-V	USD 5.500.000	USD 1.288	USD5.500.000	USD	1.000	99,87	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US037833CD08	Apple 2016-2046 3,85% USD Callable	3,85	2016	—	04-VIII-2046	04-II; 04-VIII	04-VIII	USD 2.000.000	USD 824	USD2.000.000	USD	1.000	99,74	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito, fino al 04-II-2046, in ogni momento per l'intero ammontare.
XS1048518358	ArcelorMittal 2014-2019 3%	3,00	2014	—	25-III-2019	25-III	25-III	750.000	1.400	750.000	1000	99,65	—	
XS1084568762	ArcelorMittal 2014-2020 2,87%	2,87	2014	—	06-VII-2020	06-VII	06-VII	600.000	700	600.000	1000	99,18	—	
XS1214673722	ArcelorMittal 2015-2021 3%	3,00	2015	—	09-IV-2021	09-IV	09-IV	500.000	8.000	500.000	1000	99,55	—	
XS1167308128	ArcelorMittal 2015-2022 3,125%	3,13	2015	—	14-I-2022	14-I	14-I	750.000	6.500	750.000	1000	99,73	—	
FR0010817452	Areva 2009-2019 4,375%	4,38	2009	—	06-XI-2019	06-XI	06-XI	750.000	1.450	750.000	50000	99,81	—	
FR0010804500	Areva 2009-2024 4,875%	4,88	2009	—	23-IX-2024	23-IX	23-IX	1.000.000	3.450	1.000.000	50000	98,92	—	
FR0010941690	Areva 2010-2021 3,5%	3,50	2010	—	22-IX-2020	22-IX	—	750.000	2.300	750.000	50000	99,54	—	
FR0011560986	Areva 2013-2020 3,25%	3,25	2013	—	04-IX-2020	04-IX	04-IX	500.000	9.100	500.000	100000	99,29	—	
FR0011791391	Areva 2014-2023 3,125% Callable	3,13	2014	—	20-III-2023	20-III	20-III	750.000	2.500	750.000	100000	99,49	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole con preavviso di almeno 90 giorni.	
XS0625841142	Bank of America 2011-2018 TV Floored Capped Invest Bond	1,00	2011	—	10-V-2018	10-II; 10-V; 10-VIII; 10-XI	10-V	19.338	791	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	7.195	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.	
IT0006703208	Barclays Bank 2009-2019 6%	6,00	2009	—	21-VII-2019	21-VII	21-VII	51.754	5.088	200.000	1000	100,00	—	
IT0006708413	Barclays Bank 2009-2019 Floating Rate Notes USD	1,49	2009	—	12-X-2019	12-IV; 12-X	12-X	USD 6.639	USD 1.383	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	5.206	200.000	1000	100,00	—	
IT0006706318	Barclays Bank 2009-2019 Zero Coupon Notes	—	2009	—	06-X-2019	—	06-X	10.089	1.612	20.000	1000	67,00	—	
IT0006712951	Barclays Bank 2010-2020 Fixed Floating Rate Notes ²⁾	0,36	2010	—	02-III-2020	02-III; 02-IX	02-III	17.676	2.662	100.000	1000	100,00	—	
IT0006715426	Barclays Bank 2010-2022 4,6%	4,60	2010	—	16-VI-2022	16-VI	16-VI	6.894	615	100.000	1000	100,00	—	
IT0006715392	Barclays Bank 2010-2025 10,5% Inverse Floater Floored Notes ³⁾	9,54	2010	—	16-VI-2025	16-VI; 16-XII	16-VI	6.381	2.472	100.000	1000	100,00	—	

¹⁾ Cedole in pagamento fino al 2011 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate. - ²⁾ Prime due cedole fisse pari al 7%. Successivamente cedole indicizzate. - ³⁾ Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 10,5%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
IT0006715418	Barclays Bank 2010-2025 6% Inverse Floater Floored Notes ¹⁾	6,27	2010	—	16-VI-2025	16-VI; 16-XII	16-VI	5.097	1.001	100.000	1000	100,00	—
IT0006710880	Barclays Bank 2010-2025 Inflation Floored Notes	3,00	2010	—	07-I-2025	07-I	07-I	10.025	1.497	108.200	1000	100,00	—
IT0006712142	Barclays Bank 2010-2025 Scudo 7,5%	1,96	2010	—	29-I-2025	29-I; 29-IV; 29-VII; 29-X	29-I	15.537	1.618	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	1.500	1.000.000	1000	99,53	—
IT0006729377	Barclays Bank 2014-2024 2,8%	2,80	2014	—	20-VI-2024	20-VI	20-VI	500.000	3.000	500.000	200000	100,00	—
DE000A1R0XG3	Basf 2012-2022 2%	2,00	2012	—	05-XII-2022	05-XII	05-XII	1.250.000	651	1.250.000	1000	98,82	—
XS1363560548	BMW Finance 2016-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,11	2016	—	15-VII-2019	15-I; 15-IV; 15-VII; 15-X	15-VII	500.000	551	500.000	1000	100,00	—
XS1235187306	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto AUD ²⁾	6,68	2015	—	03-VI-2023	03-III; 03-VI; 03-IX; 03-XII	03-VI	AUD 60.000	AUD 23.784	AUD 60.000	AUD 2.000	100,00	—
XS1235201735	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto NZD ³⁾	10,68	2015	—	03-VI-2023	03-III; 03-VI; 03-IX; 03-XII	03-VI	NZD 45.000	NZD 12.506	NZD 50.000	NZD 2.000	100,00	—
XS1218967377	BNP Paribas 2015-2023 Tasso Misto USD ⁴⁾	1,17	2015	—	27-IV-2023	27-I; 27-IV 27-VII; 27-X	27-IV	USD 107.000	USD 27.228	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	2.100	1.500.000	1000	99,64	—
XS1325645825	BNP Paribas 2015-2026 2,75%	2,75	2015	—	27-I-2026	27-I	27-I	750.000	600	750.000	1000	100,00	—
IT0006731068	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2014-2017 10% BRL	10,00	2014	—	02-XII-2017	02-XII	02-XII	BRL 105.000	BRL 66.665	BRL 125.000	BRL 1.000	100,00	—
IT0006731605	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2020 4,5% MXN	4,50	2015	—	02-II-2020	02-II	02-II	MXN 250.000	MXN 144.200	MXN 700.000	MXN 25.000	100,00	—
IT0006731613	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2020 8% TRY	8,00	2015	—	02-II-2020	02-II	02-II	TRY 20.000	TRY 4.376	TRY 100.000	TRY 4.000	100,00	—
XS1319787153	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2023 Inverse Floater USD ⁵⁾	1,34	2015	—	25-XI-2023	25-V; 25-XI	25-XI	USD 10.000	USD 2.398	USD 50.000	USD 2.000	100,00	—
XS1257901600	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2023 Tasso Misto ⁶⁾	1,00	2015	—	22-VII-2023	22-I; 22-IV; 22-VII; 22-X	22-VII	GBP 17.000	GBP 8.589	GBP 50.000	GBP 1.000	100,00	—
XS1289967298	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2015-2025 Tasso Misto USD ⁷⁾	5,00	2015	—	22-IX-2022	22-III; 22-VI; 22-IX; 22-XII	22-IX	USD 55.000	USD 16.122	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
XS1365096087	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 2,70% USD Callable	2,70	2016	—	02-III-2026	02-III	02-III	USD 10.000	USD 906	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.
XS1365095865	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 3,75% AUD	3,75	2016	—	02-III-2026	02-III	02-III	AUD 10.000	AUD 1.538	AUD 10.000	AUD 2.000	100,00	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 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. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2016 pari al 5,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) 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 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
XS1408405725	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 Misto Misto USD ¹⁾	1,38	2016	—	25-V-2026	25-II; 25-V; 25-VIII; 25-XI	25-V
XS1385360505	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 Tasso Misto	4,55	2016	—	12-IV-2026	12-I; 12-IV; 12-VII; 12-X	12-IV
XS0547796077	BP Capital Markets 2010-2017 3,83%	3,83	2010	—	06-X-2017	06-X	06-X
FR0012074284	Casino Guichard-Perrachon 2014-2026 4,048%	4,05	2014	—	05-VIII-2026	05-VIII	05-VIII
XS1468525057	Cellnex Telecom 2016-2024 2,375% Callable	2,38	2016	—	16-I-2024	16-I	16-I
XS1190302775	Citigroup 2015-2022 Fixed to Capped and Floored Floating Rate Notes ²⁾	0,33	2015	—	18-II-2022	18-II; 18-V; 18-VIII; 18-XI	18-II
XS1241228649	Citigroup 2015-2023 Fixed to Capped Floating Rate Notes USD ³⁾	0,80	2015	—	15-VI-2023	15-III; 15-VI; 15-IX; 15-XII	15-VI
XS1346520981	Citigroup Global Markets Holdings 2016-2021 USD Tasso Misto ⁴⁾	0,19	2016	—	03-III-2021	03-III; 03-VI; 03-IX; 03-XII	03-III
XS1389223758	Citigroup Global Markets Holdings 2017-2025 USD Tasso Misto ⁵⁾	4,00	2017	—	25-IV-2025	25-IV	25-IV
XS0604641034	CNH Industrial Finance Europe 2011-2018 6,25%	6,25	2011	—	09-III-2018	09-III	09-III
XS1046851025	CNH Industrial Finance Europe 2014-2019 2,75%	2,75	2014	—	18-III-2019	18-III	18-III
XS1114452060	CNH Industrial Finance Europe 2014-2021 2,875%	2,88	2014	—	27-IX-2021	27-IX	27-IX
XS1412424662	CNH Industrial Finance Europe 2016-2023 2,875%	2,88	2016	—	17-V-2023	17-V	17-V
DE000CZ40LW5	Commerzbank 2017-2027 4%	4,00	2017	—	30-III-2027	30-III	30-III
XS1169630602	Credit Agricole 2015-2022 0,875%	0,88	2015	—	19-I-2022	19-I	19-I
XS1093338082	Credit Suisse 2014-2019 Yield Securities	0,41	2014	—	31-X-2019	31-I; 31-IV; 31-VII; 31-X	31-X
XS1289106038	Credit Suisse 2016-2016 Tasso Misto USD ⁶⁾	1,50	2016	—	26-II-2026	26-II; 26-V; 26-VIII; 26-XI	26-II
XS1355035335	Credit Suisse 2016-2024 Tasso Misto	0,07	2016	—	30-III-2024	30-III	30-III
XS1396700194	Credit Suisse 2016-2024 Tasso Misto USD ⁷⁾	1,00	2016	—	07-VI-2024	07-III; 07-VI; 07-IX; 07-XII	07-VI
XS1289165711	Credit Suisse 2016-2026 3,5% USD	3,50	2016	—	26-I-2026	26-I	26-I

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

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)		Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)		Importo nominale emesso (migliaia di euro)		Valore nominale unitario (in euro)		Prezzo di emissione %		Note sulle modalità di rimborso	
USD	10.000	USD	2.620	USD	10.000	USD	2.000	100,00	—		
GBP	7.000	GBP	1.823	GBP	7.000	GBP	1.000	100,00	—		
	1.000.000		750		1.000.000		1000	99,96	—		
	900.000		1.500		900.000		100000	100,00	—		
	750.000		800		750.000		100000	100,00	—		
USD	40.000	USD	12.728	USD	40.000	USD	2.000	100,00	—		
USD	10.500	USD	2.264	USD	20.000	USD	2.000	100,00	—		
USD	20.000	USD	6.454	USD	20.000	USD	2.000	100,00	—		
USD	20.000	USD	1.252	USD	20.000	USD	2.000	100,00	—		
	1.200.000		1.900		1.200.000		1000	100,00	—		
	1.000.000		11.800		1.000.000		1000	99,47	—		
	700.000		9.500		700.000		1000	99,22	—		
	500.000		25.300		500.000		1000	99,22	—		
	500.000		5.205		500.000		1000	98,97	—		
	1.500.000		700		1.500.000		100000	100,00	—		
USD	23.788	USD	1.784	USD	50.000	USD	1.000	100,00	—		
USD	60.000	USD	20.117	USD	100.000	USD	1.000	100,00	—		
	15.000		2.041		100.000		1000	100,00	—		
USD	25.000	USD	3.309	USD	50.000	USD	1.000	100,00	—		
USD	34.751	USD	19.763	USD	100.000	USD	1.000	100,00	—		

fino al IV-2019 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole annuali fisse in pagamento fino al 2018 pari al 6%. Successivamente cedole trimestrali indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al VI-2019 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
XS1494536367	Credit Suisse 2016-2026 3% Callable USD	3,00	2016	—	12-X-2026	12-X	12-X
XS1444047697	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto AUD ¹⁾	6,00	2016	—	14-IX-2026	14-IX	14-IX
XS1396701168	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto GBP ²⁾	1,00	2016	—	07-VI-2026	07-III; 07-VI; 07-IX; 07-XII	07-VI
XS1354962273	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto USD ³⁾	4,30	2016	—	29-IV-2026	29-I; 29-IV; 29-VII; 29-X	29-IV
XS1396632504	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto USD ⁴⁾	6,50	2016	—	13-VII-2026	13-VII	13-VII
XS1583935140	Credit Suisse 2017-2019 7,2% RUB	7,20	2017	—	19-IV-2019	19-IV	19-IV
XS158393954	Credit Suisse 2017-2020 6,5% MXN	6,50	2017	—	19-IV-2020	19-IV	19-IV
XS1567811341	Credit Suisse 2017-2027 Tasso Misto GBP ⁵⁾	4,00	2017	—	15-III-2027	15-III	15-III
XS1532610323	Credit Suisse 2017-2027 Tasso Misto USD ⁶⁾	6,00	2017	—	09-I-2027	09-I	09-I
XS1552684687	Credit Suisse 2017-2027 Tasso Misto USD ⁷⁾	4,00	2017	—	21-II-2027	21-II	21-II
XS1204154410	Crédit Agricole 2015-2027 2,625%	2,63	2015	—	17-III-2027	17-III	17-III
DE000DB7XIJ2	Deutsche Bank 2015-2025 2,75%	2,75	2015	—	17-II-2025	17-II	17-II
DE000DL19SS0	Deutsche Bank 2016-2018 Tasso Indicizzato Euribor 3 Mesi	0,16	2016	—	13-IV-2018	13-I; 13-IV; 13-VII; 13-X	13-IV
DE000DL40SR8	Deutsche Bank 2016-2026 4,5%	4,50	2016	—	19-V-2026	19-V	19-V
XS0166179381	Deutsche Telekom International Finance 2003-2018 6,625%	6,63	2003	—	29-III-2018	29-III	29-III
XS0850057588	Deutsche Telekom International Finance 2012-2019 2%	2,00	2012	—	30-X-2019	30-X	30-X
XS1382792197	Deutsche Telekom International Finance 2016-2023 0,625%	0,63	2016	—	03-IV-2023	03-IV	03-IV
XS1617898363	Deutsche Telekom International Finance 2017-2026 1,125%	1,13	2017	—	22-V-2026	22-V	22-V
XS0162990229	EDF 2003-2033 5,625%	5,63	2003	—	21-II-2033	21-II	21-II
XS0452188054	Enel Finance International 2009-2024 5,625% GBP	5,63	2009	—	14-VIII-2024	14-VIII	14-VIII

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)		Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)		Importo nominale emesso (migliaia di euro)		Valore nominale unitario (in euro)		Prezzo di emissione %		Note sulle modalità di rimborso	
USD	22.000	USD	5.482	USD	50.000	USD	1.000	100,00	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 12-X-2020, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.	
AUD	30.000	AUD	22.432	AUD	50.000	AUD	2.000	100,00	100,00	—	
GBP	25.000	GBP	11.500	GBP	50.000	GBP	1.000	100,00	100,00	—	
USD	50.000	USD	24.703	USD	50.000	USD	1.000	100,00	100,00	—	
USD	50.000	USD	57.068	USD	50.000	USD	1.000	100,00	100,00	—	
RUB	3.500.000	RUB	127.400	RUB	3.500.000	RUB	350.000	100,00	100,00	—	
MXN	1.000.000	MXN	11.500	MXN	1.000.000	MXN	100.000	100,00	100,00	—	
GBP	15.000	GBP	2.471	GBP	50.000	GBP	1.000	100,00	100,00	—	
USD	22.000	USD	4.878	USD	50.000	USD	1.000	100,00	100,00	—	
USD	50.000	USD	6.349	USD	50.000	USD	1.000	100,00	100,00	—	
	2.000.000		1.100		2.000.000		1000	100,00	100,00	—	
	1.250.000		33.488		1.250.000		1000	99,72	99,72	—	
	1.250.000		5.100		1.250.000		100000	99,90	99,90	—	
	750.000		4.000		750.000		1000	99,66	99,66	—	
	500.000		726		500.000		1000	99,00	99,00	—	
	500.000		1.909		500.000		1000	99,72	99,72	—	
	1.750.000		1.654		1.750.000		1000	100,00	100,00	—	
	750.000		614		750.000		1000	100,00	100,00	—	
	850.000		643		850.000		1000	98,90	98,90	—	
GBP	850.000	GBP	850	GBP	850.000	GBP	1.000	98,80	98,80	—	

1) Cedole fisse in pagamento fino al IX-2018 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al VI-2019 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al IV-2021 pari al 4,30%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al VII-2018 pari al 6,50%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al III-2019 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al I-2019 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al II-2023 pari al 4%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
XS0452187320	Enel Finance International 2009-2040 5,75% GBP	5,75	2009	—	14-IX-2040	14-IX	14-IX	GBP 1.400.000	GBP 2.550	GBP1.400.000	GBP	1.000	99,40	—
XS0827692269	Enel Finance International 2012-2020 4,875%	4,88	2012	—	11-III-2020	11-III	11-III	1.000.000	1.400	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	1.600	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	1.400	1.462.603		1000	100,00	—
XS1425966287	Enel Finance International 2016-2026 1,375%	1,38	2016	—	01-VI-2026	01-VI	01-VI	1.257.412	1.300	1.257.412		1000	98,83	—
XS1550149204	Enel Finance International 2017-2024 1% Green Bond	1,00	2017	—	16-IX-2024	16-IX	16-IX	1.250.000	600	1.250.000		1000	99,00	—
XS0177089298	Enel Investment Holding 2003-2023 5,25%	5,25	2003	—	29-IX-2023	29-IX	29-IX	300.000	4.218	300.000		1000	98,76	—
XS1119021357	Exor 2014-2024 2,5%	2,50	2014	—	08-X-2024	08-X	08-X	500.000	4.300	500.000		1000	99,33	—
XS1329671132	Exor 2015-2022 2,125%	2,13	2015	—	02-XII-2022	02-XII	02-XII	750.000	2.900	750.000		1000	100,00	—
XS1380394806	Ferrari 2016-2023 1,5%	1,50	2016	—	16-III-2023	16-III	16-III	500.000	10.700	500.000		1000	100,00	—
US31562QAC15	Fiat Chrysler Automobiles 2015-2020 4,5% USD	4,50	2015	—	15-IV-2020	15-IV; 15-X	15-IV	USD 1.460.345	USD 5.600	USD1.460.345	USD	1.000	100,00	—
US31562QAF46	Fiat Chrysler Automobiles 2015-2023 5,25% USD Callable	5,25	2015	—	15-IV-2023	15-IV; 15-X	15-IV	USD 1.467.939	USD 14.800	USD1.467.939	USD	1.000	100,00	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
XS1388625425	Fiat Chrysler Automobiles 2016-2024 3,75%	3,75	2016	—	29-III-2024	29-III	29-III	1.250.000	132.400	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	14.000	600.000		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	11.800	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	18.000	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	22.900	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	25.500	850.000		1000	100,00	—
XS1042118106	GE Capital 2014-2020 2,5% USD	2,50	2014	—	28-III-2020	28-III; 28-IX	28-III	USD 505.000	USD 57.066	USD 505.000	USD	2.000	99,76	—
XS1042118288	GE Capital 2014-2020 Floating Rate USD	0,44	2014	—	28-III-2020	28-III; 28-VI; 28-IX; 28-XII	28-III	USD 245.000	USD 41.322	USD 245.000	USD	2.000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
XS0794230507	GE Capital European Funding 2,87%	2,87	2012	—	18-VI-2019	18-VI	18-VI	1.250.000	503	1.250.000	1000	99,71	—	
XS0340180149	GE Capital European Funding 2008-2018 5,37%	5,37	2008	—	16-I-2018	16-I	16-I	1.250.000	1.777	1.250.000	1000	99,71	—	
XS0453908377	GE Capital European Funding 2009-2020 5,375%	5,38	2009	—	23-I-2020	23-I	23-I	1.500.000	727	1.500.000	1000	99,32	—	
XS0954025267	GE Capital European Funding 2013-2020 2,25%	2,25	2013	—	20-VII-2020	20-VII	20-VII	1.000.000	650	1.000.000	1000	99,64	—	
XS1078030928	GE Capital European Funding 2014-2018 Indicizzato Euribor 3 mesi	0,15	2014	—	19-VI-2018	19-III; 19-VI; 19-IX; 19-XII	19-VI	500.000	3.000	500.000	1000	100,00	—	
FR0010014845	GIE PSA Tesorerie 2003-2033 6%	6,00	2003	—	19-IX-2033	19-IX	19-IX	600.000	40.725	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	700	750.000	1000	99,65	—	
XS1110430193	Glencore Finance Europe 2014-2022 1,625%	1,63	2014	—	18-I-2022	18-I	18-I	700.000	1.200	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	2.300	500.000	1000	99,43	—	
XS1202849086	Glencore Finance Europe 2015-2025 1,75%	1,75	2015	—	17-III-2025	17-III	17-III	750.000	2.700	750.000	1000	99,27	—	
XS1561104693	Goldman Sachs Finance Corporation International 2017-2022 2,5% USD	2,50	2017	—	24-V-2022	24-V	24-V	USD 90.000	USD 938	USD 90.000	USD	2.000	100,00	—
XS1561100600	Goldman Sachs Finance Corporation International 2017-2027 Fixed to Floating ¹⁾	3,25	2017	—	20-IV-2027	20-IV	20-IV	90.000	45.375	90.000	1000	100,00	—	
XS1130101931	Goldman Sachs Group 2014-2019 Tasso Variabile	0,21	2014	—	29-X-2019	29-I; 29-IV; 29-VII; 29-X	29-X	1.250.000	1.855	1.250.000	1000	99,85	—	
XS1240146891	Goldman Sachs Group 2015-2020 Tasso Variabile	0,17	2015	—	29-V-2020	29-II; 29-V; 29-VIII; 29-XI	29-V	1.500.000	1.054	1.500.000	1000	100,00	—	
XS1458408306	Goldman Sachs Group 2016-2021 Tasso Variabile	0,18	2016	—	27-VII-2021	27-I; 27-IV; 27-VII; 27-X	27-VII	2.000.000	679	2.000.000	1000	100,00	—	
XS1458408561	Goldman Sachs Group 2016-2026 1,625%	1,63	2016	—	27-VII-2026	27-VII	27-VII	2.000.000	960	2.000.000	1000	99,84	—	
XS1213053991	Goldman Sachs International 2015-2021 4% NZD	4,00	2015	—	13-VII-2021	13-VII	13-VII	NZD 50.000	NZD 6.376	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 7.566	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 35.968	USD 100.000	USD	2.000	100,00	—

¹⁾ Cedole fisse in pagamento fino al IV-2019 pari al 3,25%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
XS1241026936	Goldman Sachs International 2015-2025 3,5% Callable USD	3,50	2015	—	15-IX-2025	15-IX	15-IX
XS1241085353	Goldman Sachs International 2015-2027 Fixed to Floating ¹⁾	0,75	2015	—	26-XI-2027	26-II; 26-V; 26-VIII; 26-XI	26-XI
XS1318212633	Goldman Sachs International 2016-2016 Fixed to Floating USD	6,25	2016	—	20-VI-2026	20-VI	20-VI
XS1402088170	Goldman Sachs International 2016-2026 3% USD Callable	3,00	2016	—	07-IX-2026	07-IX	07-IX
XS1317825948	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Digital Coupon Notes linked to th ²⁾	2,50	2016	—	02-IX-2026	02-IX	02-IX
XS1267261805	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating USD ³⁾	1,50	2016	—	15-I-2026	15-I; 15-IV; 15-VII; 15-X	15-I
XS1317259148	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating USD ⁴⁾	1,06	2016	—	22-IV-2026	22-I; 22-IV; 22-VII; 22-X	22-IV
XS1457382296	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating USD ⁵⁾	3,25	2016	—	28-X-2026	28-X	28-X
XS1317278361	Goldman Sachs International 2016-2026 Switchable Fixed to Floating USD ⁶⁾	4,65	2016	—	17-V-2026	17-V	17-V
XS1317187646	Goldman Sachs International 2016-2028 Tasso Misto ⁷⁾	3,50	2016	—	10-III-2028	10-III	10-III
XS1505106192	Goldman Sachs International 2017-2020 6,25% MXN	6,25	2017	—	17-III-2020	17-III	17-III
XS1505105970	Goldman Sachs International 2017-2020 7,25% ZAR	7,25	2017	—	17-III-2020	17-III	17-III
XS1505033453	Goldman Sachs International 2017-2025 Fixed to US Inflation Linked Floating USD ⁸⁾	4,25	2017	—	17-II-2025	17-II	17-II
XS1457442025	Goldman Sachs International 2017-2027 Fixed to Floating USD ⁹⁾	6,00	2017	—	20-I-2027	20-I	20-I
XS0496716282	Italcementi Finance 2010-2020 5,375%	5,38	2010	—	19-III-2020	19-III	19-III
XS0893201433	Italcementi Finance 2013-2018 6,125%	6,13	2013	—	21-II-2018	21-II	21-II

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2017 pari al 3%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse in pagamento fino al IX-2018 pari al 2,50%. Successivamente cedole pari al 2,5% se l'indice Solactive Eurozone 50 Equal Weight 5 AR Index è pari o superiore al valore di riferimento. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al IV-2019 pari al 4,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al X-2021 pari al 3,25%.

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
USD 100.000	USD 12.756	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.
50.000	1.695	50.000	1000	100,00	—
USD 100.000	USD 41.914	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
USD 100.000	USD 12.922	USD 100.000	USD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato a partire dal 7-IX-2019, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
50.000	744	50.000	1000	100,00	—
USD 100.000	USD 35.648	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
USD 100.000	USD 8.688	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
USD 100.000	USD 2.704	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
USD 100.000	USD 12.194	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
75.000	1.146	75.000	1000	100,00	—
MXN 800.000	MXN 36.750	MXN 800.000	MXN 25.000	100,00	—
ZAR 500.000	ZAR 38.000	ZAR 500.000	ZAR 20.000	100,00	—
USD 75.000	USD 3.188	USD 75.000	USD 2.000	100,00	—
USD 100.000	USD 68.970	USD 100.000	USD 2.000	100,00	—
750.000	12.100	750.000	1000	99,22	—
350.000	1.500	350.000	1000	99,48	—

Successivamente cedole indicizzate. - 6) 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. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 3,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 8) Cedole fisse in pagamento fino al II-2019 pari al 4,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 9) Cedole fisse in pagamento fino al I-2019 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
XS1308021846	IVS Group 2015-2022 4,5% Callable	4,50	2015	—	15-XI-2022	15-XI	15-XI	240.000	77.060	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%.	
XS1069522057	Jefferies Group 2014-2020 2,375%	2,38	2014	—	20-V-2020	20-V	20-V	500.000	1.300	500.000	1000	99,75	—	
IT0006598830	KFW 2005-2025 Fixed to CMS Cap-ped	0,75	2005	—	09-XII-2025	09-XII	09-XII	50.000	1.085	50.000	1000	100,00	—	
US500769DP65	KFW 2010-2020 4% USD	4,00	2010	—	27-I-2020	27-I; 27-VII	27-I	USD 4.000.000	USD 758	USD 4.000.000	USD	1.000	99,66	—
XS0619263485	KFW 2011-18 3,125% USD	3,13	2011	—	20-IV-2018	20-IV	20-IV	USD 1.000.000	USD 939	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 4.749	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 83.755	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 1.084	USD 2.500.000	USD	1.000	99,83	—
US500769FH22	KFW 2012-2022 2% USD	2,00	2012	—	04-X-2022	04-IV; 04-X	04-X	USD 3.000.000	USD 1.254	USD 3.000.000	USD	1.000	98,98	—
XS0972246093	KFW 2013-2017 8,5% TRY	8,50	2013	—	19-IX-2017	19-IX	19-IX	TRY 400.000	TRY 9.032	TRY 400.000	TRY	1.000	101,14	—
XS0943420231	KFW 2013-2018 3,75% NZD	3,75	2013	—	14-VI-2018	14-VI	14-VI	NZD 425.000	NZD 774	NZD 425.000	NZD	1.000	101,47	—
XS0907335599	KFW 2013-2018 5,75% TRY	5,75	2013	—	22-III-2018	22-III	22-III	TRY 510.000	TRY 6.331	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 23.060	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 17.445	BRL 340.000	BRL	5.000	101,38	—
XS1042116746	KFW 2014-2019 10% TRY	10,00	2014	—	06-III-2019	06-III	06-III	TRY 135.000	TRY 3.298	TRY 135.000	TRY	1.000	99,87	—
XS1133657657	KFW 2014-2019 4,25% NZD	4,25	2014	—	06-XI-2019	06-XI	06-XI	NZD 150.000	NZD 1.171	NZD 150.000	NZD	1.000	101,29	—
XS1100379459	KFW 2014-2020 4,5% NZD	4,50	2014	—	20-VIII-2020	20-VIII	20-VIII	NZD 150.000	NZD 2.486	NZD 150.000	NZD	1.000	100,84	—
XS1075906252	KFW 2014-2020 7,875% ZAR	7,88	2014	—	15-I-2020	15-I	15-I	ZAR 300.000	ZAR 19.365	ZAR 300.000	ZAR	5.000	99,22	—
US500769GT50	KFW 2015-2018 1,125% USD	1,13	2015	—	16-XI-2018	16-V; 16-XI	—	USD 4.000.000	USD 1.586	USD 4.000.000	USD	1.000	99,87	—
XS1315160702	KFW 2015-2019 12% BRL	12,00	2015	—	04-XI-2019	04-XI	04-XI	BRL 250.000	BRL 5.860	BRL 250.000	BRL	5.000	98,65	—
XS1234897483	KFW 2015-2020 9,25% TRY	9,25	2015	—	22-V-2020	22-V	22-V	TRY 175.000	TRY 3.967	TRY 175.000	TRY	1.000	99,48	—
US500769GQ12	KFW 2015-2025 2% USD	2,00	2015	—	02-V-2025	02-V; 02-XI	02-V	USD 3.000.000	USD 646	USD 3.000.000	USD	1.000	99,64	—
DE000A11QTF7	KFW 2015-2030 0,375%	0,38	2015	—	23-IV-2030	23-IV	23-IV	2.000.000	2.113	2.000.000	1000	99,72	—	

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

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
US500769GY46	KFW 2016-2018 0,875% USD	0,88	2016	—	19-IV-2018	19-IV; 19-X	19-IV	USD 6.000.000	USD 1.014	USD6.000.000	USD 1.000	99,77	—
US500769HA50	KFW 2016-2019 1% USD	1,00	2016	—	15-VII-2019	15-I; 15-VII	15-VII	USD 5.000.000	USD 749	USD5.000.000	USD 1.000	99,97	—
XS1520710788	KFW 2016-2019 5,5% MXN	5,50	2016	—	22-XI-2019	22-XI	22-XI	MXN 1.500.000	MXN 15.420	MXN1.500.000	MXN 10.000	98,86	—
XS1508846919	KFW 2016-2019 8,75% BRL	8,75	2017	—	15-IV-2019	15-IV	15-IV	BRL 150.000	BRL 3.390	BRL 150.000	BRL 5.000	99,24	—
US500769GZ11	KFW 2016-2021 1,5% USD	1,50	2016	—	15-VI-2021	15-VI; 15-XII	15-VI	USD 5.000.000	USD 1.458	USD5.000.000	USD 1.000	99,77	—
US500769GX62	KFW 2016-2021 1,625% USD	1,63	2016	—	15-III-2021	15-III; 15-IX	15-III	USD 4.000.000	USD 610	USD4.000.000	USD 1.000	100,00	—
XS1399387478	KFW 2016-2021 9,75% TRY	9,75	2016	—	17-II-2021	17-II	17-II	TRY 1.250.000	TRY 4.418	TRY1.250.000	TRY 1.000	101,61	—
XS1069178173	Landwirtschaftliche Rentenbank 2014-2022 8,25% ZAR	8,25	2014	—	23-V-2022	23-V	23-V	ZAR 1.250.000	ZAR 38.625	ZAR1.250.000	ZAR 5.000	100,36	—
XS0828235225	Linde Aktiengesellschaft 2012-2020 1,75%	1,75	2012	—	17-IX-2020	17-IX	17-IX	1.000.000	1.920	1.000.000	1000	99,28	—
XS0449361350	Lloyds TSB Bank 2009-2019 5,375%	5,38	2009	—	03-IX-2019	03-IX	03-IX	1.500.000	550	1.500.000	1000	99,92	—
XS0497187640	Lloyds TSB Bank 2010-2020 Lower-Tier2 6,5%	6,50	2010	—	24-III-2020	24-III	24-III	1.500.000	1.350	1.500.000	1000	99,71	—
FR0012173706	LVMH 2014-2021 1%	1,00	2014	—	24-IX-2021	24-IX	24-IX	650.000	556	650.000	1000	99,46	—
DE000A13R8M3	Metro 2014-2021 1,375%	1,38	2014	—	28-X-2021	28-X	28-X	500.000	596	500.000	1000	99,25	—
XS1203941775	Metro 2015-2025 1,5%	1,50	2015	—	19-III-2025	19-III	19-III	600.000	1.791	600.000	1000	99,83	—
US594918BR43	Microsoft 2016-2026 2,4% USD Callable	2,40	2016	—	08-VIII-2026	08-II; 08-VIII	08-VIII	USD 4.000.000	USD 1.204	USD4.000.000	USD 1.000	99,81	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito, fino al 08-V-2026, in ogni momento per l'intero ammontare.
XS1366716261	Morgan Stanley 2016-2021 Fixed Rate Step-Up GBP ¹⁾	1,60	2016	—	29-III-2021	29-III	29-III	GBP 7.500	GBP 838	GBP 7.500	GBP 1.000	100,00	—
FR0013217114	Orange 2016-2027 0,875%	0,88	2016	—	03-II-2027	03-II	03-II	750.000	2.100	750.000	100000	99,54	—
XS0213101073	Pemex 2005-2025 5,5%	5,50	2005	—	24-II-2025	24-II	24-II	1.000.000	5.100	1.000.000	10000	99,09	—
US71654QBH48	Pemex 2013-2024 4,875% USD Callable	4,88	2013	—	18-I-2024	18-I; 18-VII	18-I	USD 1.499.136	USD 5.260	USD1.499.136	USD 10.000	99,48	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US71645WAQ42	Petrobras Global Finance 2009-2040 6,875% USD Callable	6,88	2009	—	20-I-2040	20-I; 20-VII	20-I	USD 1.500.000	USD 2.008	USD1.500.000	USD 1.000	98,45	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US71645WAR25	Petrobras Global Finance 2011-2021 5,375% USD Callable	5,38	2011	—	27-I-2021	27-I; 27-VII	27-I	USD 5.250.000	USD 2.352	USD5.250.000	USD 1.000	99,80	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
XS0716979595	Petrobras Global Finance 2011-2022 5,875% Callable	5,88	2011	—	07-III-2022	07-III	07-III	600.000	2.400	600.000	1000	99,27	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito, in ogni momento per l'intero ammontare.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
XS0718502007	Petrobras Global Finance 2011-2026 6,25% Callable GBP	6,25	2011	—	14-XII-2026	14-XII	14-XII	GBP 700.000	GBP 1.400	GBP 700.000	GBP	1.000	97,83	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US71645WAS08	Petrobras Global Finance 2011-2041 6,75% USD Callable	6,75	2011	—	27-I-2041	27-I; 27-VII	27-I	USD 2.250.000	USD 900	USD 2.250.000	USD	1.000	99,29	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US71647NAM11	Petrobras Global Finance 2011-2024 6,25% USD Callable	6,25	2014	—	17-III-2024	17-III; 17-IX	17-III	USD 2.500.000	USD 1.050	USD 2.500.000	USD	1.000	99,77	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
XS0835886598	Petrobras Global Finance 2012-2019 3,25% Callable	3,25	2012	—	01-IV-2019	01-IV	01-IV	1.300.000	1.600	1.300.000	1000	1000	99,40	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
XS0835890350	Petrobras Global Finance 2012-2023 4,25% Callable	4,25	2012	—	02-X-2023	02-X	02-X	700.000	3.200	700.000	1000	1000	98,15	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US71647NAF69	Petrobras Global Finance 2013-2023 4,375% USD Callable	4,38	2013	—	20-V-2023	20-V; 20-XI	20-V	USD 3.500.000	USD 2.294	USD 3.500.000	USD	1.000	98,83	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US71647NAA72	Petrobras Global Finance 2013-2043 5,625% USD Callable	5,63	2013	—	20-V-2043	20-V; 20-XI	20-V	USD 1.750.000	USD 1.852	USD 1.750.000	USD	1.000	98,03	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
XS0982711987	Petrobras Global Finance 2014-2021 3,75% Callable	3,75	2014	—	14-I-2021	14-I	14-I	750.000	1.100	750.000	1000	1000	99,40	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito, in ogni momento per l'intero ammontare.
XS0982711714	Petrobras Global Finance 2014-2025 4,75% Callable	4,75	2014	—	14-I-2025	14-I	14-I	800.000	6.200	800.000	1000	1000	99,20	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
US71647NAK54	Petrobras Global Finance 2014-2044 7,25% USD Callable	7,25	2014	—	17-III-2044	17-III; 17-IX	17-III	USD 1.000.000	USD 1.508	USD 1.000.000	USD	1.000	99,17	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
FR0011233451	Peugeot 2012-22017 5,625%	5,63	2012	—	11-VII-2017	11-VII	11-VII	600.000	2.174	600.000	1000	1000	99,47	—
FR0011439975	Peugeot 2013-2018 7,375%	7,38	2013	—	06-III-2018	06-III	06-III	1.000.000	5.085	1.000.000	1000	1000	99,49	—
FR0011567940	Peugeot 2013-2019 6,5%	6,50	2013	—	18-I-2019	18-I	18-I	600.000	3.100	600.000	1000	1000	99,37	—
FR0013153707	Peugeot 2016-2023 2,375%	2,38	2016	—	14-IV-2023	14-IV	14-IV	500.000	7.278	500.000	1000	1000	100,00	—
FR0013245586	Peugeot 2017-2024 2% Callable	2,00	2017	—	23-III-2024	23-III	23-III	600.000	3.150	600.000	1000	1000	100,00	L'emittente ha la facoltà di rimborsare il prestito in ogni momento per l'intero ammontare.
XS0462994343	Portugal Telecom International Finance 2009-2019 5%	5,00	2009	—	04-XI-2019	04-XI	04-XI	750.000	34.700	750.000	1000	1000	99,63	—
XS0927581842	Portugal Telecom International Finance 2013-2020 4,625%	4,63	2013	—	08-V-2020	08-V	08-V	1.000.000	25.200	1.000.000	1000	1000	100,00	—
XS0478074924	Rabobank Nederland 2010-2020 4,125%	4,13	2010	—	14-I-2020	14-I	14-I	3.500.000	576	3.500.000	1000	1000	99,58	—
FR0012759744	RCI Banque 2015-2022 1,25%	1,25	2015	—	08-VI-2022	08-VI	08-VI	750.000	680	750.000	1000	1000	99,36	—
FR0013169778	RCI Banque 2016-2023 1% Callable	1,00	2016	—	17-V-2023	17-V	17-V	600.000	553	600.000	1000	1000	100,00	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS1487498922	Saipem Finance International 2016-2021 3% Callable	3,00	2016	—	08-III-2021	08-III	08-III	500.000	17.300	500.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato in ogni momento.
XS1487495316	Saipem Finance International 2016-2023 3,75% Callable	3,75	2016	—	08-IX-2023	08-IX	08-IX	500.000	17.700	500.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato in ogni momento.
XS1591523755	Saipem Finance International 2017-2022 2,75%	2,75	2017	—	05-IV-2022	05-IV	05-IV	500.000	18.700	500.000	1000	100,00	—
XS0456451771	Sanofi Aventis 2009-2019 4,125%	4,13	2009	—	11-X-2019	11-X	11-X	800.000	635	800.000	1000	99,82	—
XS1201001572	Santander Issuance 2015-2025 2,5%	2,50	2015	—	18-III-2025	18-III	18-III	1.500.000	600	1.500.000	100000	100,00	—
XS1119130489	SG Issuer 2014-2018 3,75% MXN	3,75	2014	—	04-XII-2018	04-XII	04-XII	MXN 500.000	MXN 13.888	MXN 500.000	MXN 16.000	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 597.030	RUB 1.750.000	RUB 70.000	100,00	—
XS1143861208	SG Issuer 2015-2019 6,75% ZAR	6,75	2015	—	04-II-2019	04-II	04-II	ZAR 330.000	ZAR 9.930	ZAR 330.000	ZAR 15.000	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 51.915.000	IDR 375.000.000	IDR 15.000.000	100,00	—
XS1212331265	SG Issuer 2015-2025 Indicizzato USD ¹⁾	0,50	2015	—	22-VI-2025	22-III; 22-VI; 22-IX; 22-XII	—	USD 100.000	USD 13.085	USD 100.000	USD 1.000	100,00	—
XS1490848279	SG Issuer 2016-2018 7,5% RUB	7,50	2016	—	19-XI-2018	19-XI	19-XI	RUB 1.750.000	RUB 269.780	RUB 1.750.000	RUB 70.000	100,00	—
XS1490842314	SG Issuer 2016-2018 8,5% BRL	8,50	2016	—	19-XI-2018	19-XI	19-XI	BRL 20.000	BRL 9.545	BRL 20.000	BRL 5.000	100,00	—
XS1526236663	SG Issuer 2017-2019 5,25% INR	5,25	2017	—	22-III-2019	22-III	22-III	INR 1.750.000	INR 122.710	INR 1.750.000	INR 70.000	100,00	—
XS1476654584	Shell International Finance 2016-2028 0,75%	0,75	2016	—	15-VIII-2028	15-VIII	15-VIII	1.000.000	1.600	1.000.000	1000	99,62	—
XS1411401083	Shell International Finance 2016-2028 1,25%	1,25	2016	—	12-V-2028	12-V	12-V	1.000.000	2.000	1.000.000	1000	98,97	—
XS1265876430	Société Générale 2015-2023 Tasso Misto USD ²⁾	1,25	2015	—	23-X-2023	23-I; 23-IV; 23-VII; 23-X	23-X	USD 80.000	USD 16.232	USD 80.000	USD 2.000	100,00	—
XS1212158965	Société Générale 2015-2025 3% Callable USD	3,00	2015	—	05-VIII-2025	05-VIII	05-VIII	USD 150.000	USD 34.630	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.
XS1265944964	Société Générale 2016-2026 Tasso Misto USD ³⁾	1,31	2016	—	03-III-2026	03-III; 03-VI; 03-IX; 03-XII	03-III	USD 50.000	USD 920	USD 50.000	USD 2.000	100,00	—
XS1265960739	Société Générale 2016-2026 Tasso Variabile Callable USD	0,51	2016	—	16-III-2026	16-III; 16-VI; 16-IX; 16-XII	16-III	USD 25.000	USD 594	USD 25.000	USD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato, con preavviso di almeno 5 giorni, in corrispondenza del 16-III di ogni anno a partire dal 16-III-2017.
XS1236574627	Société Générale 2016-2028 Tasso Misto ⁴⁾	0,88	2016	—	04-I-2028	04-I; 04-IV; 04-VII; 04-X	04-I	60.000	1.694	60.000	2000	100,00	—
XS1236580517	Société Générale 2016-2028 Tasso Misto USD ⁵⁾	1,25	2016	—	04-I-2028	04-I; 04-IV; 04-VII; 04-X	04-I	USD 80.000	USD 2.930	USD 80.000	USD 2.000	100,00	—

1) 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. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 5,25%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2018 pari al 3,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2019 pari al 5%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
XS1555910485	Société Générale 2017-2027 Tasso Variabile USD	0,52	2017	—	24-III-2027	24-III; 24-VI; 24-IX; 24-XII	24-III
XS0161100515	Telecom Italia Finance 2003-2033 7,75%	7,75	2003	—	24-I-2033		24-I
XS0999667263	Telekom Finanzmanagement 2013-2021 3,125%	3,13	2013	—	03-XII-2021		03-XII
XS1211044075	Teva Pharmaceutical Finance 2015-2027 1,875%	1,88	2015	—	31-III-2027		31-III
XS0454984765	The Royal Bank of Scotland 2009-2019 5,375%	5,38	2009	—	30-IX-2019		30-IX
NL0009560002	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Obbligazione Royal Euribor con Leva ¹⁾	—	2010	—	30-IX-2017	30-III; 30-VI; 30-IX; 30-XII	30-IX
NL0009560010	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Obbligazione Royal Step Down ²⁾	3,00	2010	—	30-IX-2017	30-III; 30-IX	30-IX
NL0009294040	The Royal Bank of Scotland 2010-2018 Obbligazione Royal Combinazione Perfetta ³⁾	10,48	2010	—	23-III-2018	23-III; 23-IX	23-III
NL0009294032	The Royal Bank of Scotland 2010-2018 Obbligazione Royal Protezione ⁴⁾	2,75	2010	—	23-III-2018	23-III	23-III
NL0009292564	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Inflazione con Cap&Floor ⁵⁾	3,00	2010	—	30-XI-2020	30-XI	30-XI
NL0009483825	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 5%	5,00	2010	—	22-VI-2020	22-VI; 22-XII	22-VI
NL0009294057	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 5% Flex ⁶⁾	—	2010	—	23-III-2020	23-III; 23-IX	23-III
NL0009483833	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 8% Steepener ⁷⁾	3,00	2010	—	22-VI-2020	22-VI; 22-XII	22-VI
NL0009408467	The Royal Bank of Scotland 2010-2022 Obbligazione Royal Operazione 10%	10,50	2010	—	05-V-2022	05-V; 05-XI	05-V
NL0009487453	The Royal Bank of Scotland 2010-2025 Obbligazione Royal Top Inverse ⁸⁾	2,31	2010	—	09-VII-2025	09-I; 09-IV; 09-VII; 09-X	09-VII
XS1382368113	The Royal Bank of Scotland 2016-2023 2,5%	2,50	2016	—	23-II-2023	23-II	—

1) Cedole fisse in pagamento fino al 2011 pari al 6,55%. Successivamente cedole indicizzate. - 2) Cedole fisse a decrescere pari al 5%, 4,65%, 4,3%, 4%, 3,7%, 3,35% e 3% annuo. - 3) Cedole fisse in pagamento fino al 2011 pari all'8%. Successivamente cedole indicizzate. - 4) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 6%. Successivamente cedole indicizzate. - 5) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
USD 250.000	USD 11.154	USD 250.000	USD 2.000	100,00	—
1.015.000	74.970	1.015.000	1000	98,24	—
750.000	523	750.000	1000	99,37	—
700.000	2.400	700.000	100000	99,50	—
2.000.000	1.100	2.000.000	1000	99,43	—
7.540	1.416	100.000	1000	100,00	—
6.320	983	100.000	1000	100,00	—
24.578	5.658	200.000	1000	100,00	—
7.152	869	100.000	1000	100,00	—
5.985	618	15.000	1000	100,00	—
114.544	12.291	250.000	1000	100,00	—
28.731	13.610	100.000	1000	100,00	—
18.667	4.730	150.000	1000	100,00	—
16.262	3.398	200.000	1000	100,00	—
19.401	4.900	100.000	1000	100,00	—
1.500.000	2.100	1.500.000	1000	99,30	—

al 4,5%. Successivamente cedole indicizzate. - 6) Cedole fisse in pagamento fino al 2015 pari al 5%. Successivamente eventuali cedole indicizzate. - 7) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari all'8%. Successivamente cedole indicizzate. - 8) Cedole fisse in pagamento fino al 2012 pari al 12%. Successivamente cedole indicizzate.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
DE000A1R08U3	Thyssenkrupp 2013-2018 4%	4,00	2013	—	27-VIII-2018	27-VIII	27-VIII	1.600.000	1.959	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	2.766	1.250.000	1000	99,20	—
DE000A14J579	Thyssenkrupp 2015-2020 1,75%	1,75	2015	—	25-XI-2020	25-XI	25-XI	750.000	3.288	750.000	1000	99,33	—
DE000A14J587	Thyssenkrupp 2015-2025 2,5%	2,50	2015	—	25-II-2025	25-II	25-II	600.000	9.560	600.000	1000	98,82	—
DE000A2AAPF1	Thyssenkrupp 2016-2021 2,75% Callable	2,75	2016	—	08-III-2021	08-III	08-III	750.000	3.559	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.
DE000A2BPET2	Thyssenkrupp 2017-2022 1,375% Callable	1,38	2017	—	03-III-2022	03-III	03-III	1.250.000	2.367	1.250.000	1000	99,59	Facoltà di rimborso anticipato in data 3-XII- 2021 con preavviso di almeno 30 giorni e non oltre i 60.
DE000UB2F5S4	UBS 2010-2017 4%	4,00	2010	—	29-VII-2017	29-VII	29-VII	70.000	3.641	70.000	1000	100,00	—
DE000UB8DSR5	UBS 2011-2017 Equity Linked Autocallable	—	2011	—	06-VII-2017	06-VII	06-VII	15.000	1.119	15.000	1000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato da parte dell'emittente al verificarsi di un evento azionario.
XS1216647716	Volkswagen Financial Services 2015-2021 0,75%	0,75	2015	—	14-X-2021	14-X	14-X	750.000	1.574	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	768	500.000	1000	98,97	—
XS0873793375	Volkswagen International Finance 2013-2020 2%	2,00	2013	—	14-I-2020	14-I	14-I	1.000.000	1.238	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	755	1.000.000	1000	99,42	—
XS1167637294	Volkswagen International Finance 2015-2018 Tasso Variabile	0,07	2015	—	16-VII-2018	16-I; 16-IV; 16-VII; 16-X	16-VII	1.000.000	1.641	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	2.373	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	8.586	1.000.000	1000	98,99	—
XS1586555861	Volkswagen International Finance 2017-2023 1,125%	1,13	2017	—	02-X-2023	02-X	02-X	1.500.000	900	1.500.000	100000	100,00	—
XS1586555945	Volkswagen International Finance 2017-2027 1,875%	1,88	2017	—	30-III-2027	30-III	30-III	2.500.000	2.500	2.500.000	100000	100,00	—
XS1014610254	Volkswagen Leasing 2014-2024 2,625%	2,63	2014	—	15-I-2024	15-I	15-I	1.250.000	3.293	1.250.000	1000	98,92	—
XS1273542867	Volkswagen Leasing 2015-2017 Tasso Variabile	0,06	2015	—	11-VIII-2017	11-II; 11-V; 11-VIII; 11-XI	11-VIII	750.000	1.850	750.000	1000	100,00	—
XS1273507100	Volkswagen Leasing 2015-2020 0,75%	0,75	2015	—	11-VIII-2020	11-VIII	11-VIII	750.000	1.071	750.000	1000	99,57	—
XS0923605470	Whirlpool 2013-2018 4,5%	4,50	2013	—	26-IV-2018	26-IV	26-IV	300.000	900	300.000	1000	99,45	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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 ENTI INTERNAZIONALI														
XS0055498413	BEI 1995-2017 8,75% GBP	8,75	2008	—	25-VIII-2017	25-VIII	25-VIII	GBP 1.000.000	GBP 2.619	GBP1.000.000	GBP	1.000	99,83	—
IT0006525932	BEI 1998-2018 Sticky Fixed Reverse Floater	9,67	1998	—	20-XI-2018	20-XI	20-XI	111.931	6.243	154.937		0,01	100,00	—
XS0086358628	BEI 1998-2018 Zero Coupon ZAR	—	1998	—	31-XII-2018	—	31-XII	ZAR 888.490	ZAR 126.985	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 622	GBP1.875.000	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 1.172	GBP3.700.000	GBP	1.000	99,16	—
IT0006527052	BEI 1999-2019 Eurostability Bond	—	1999	—	05-II-2019	—	05-II	125.342	6.869	150.000		1000	100,00	—
IT0006526609	BEI 1999-2029 Fixed & Zero	—	1999	—	22-I-2029	22-I	22-I	163.375	2.708	200.000		1000	100,00	—
IT0006527300	BEI 1999-2029 Step-Down	—	1999	—	26-II-2029	26-II	26-II	57.000	2.124	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 1.361	GBP1.600.000	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 610	GBP1.500.000	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 537	GBP2.275.000	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 2.013	GBP 600.000	GBP	1.000	99,32	—
XS0196448129	BEI 2004-2020 4,625%	4,63	2004	—	15-IV-2020	15-IV	15-IV	5.000.000	3.169	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 15.695	SEK 5.525.000	SEK	5.000	115,69	—
XS0219808549	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked	0,77	2005	—	08-VI-2020	08-VI	08-VI	103.404	6.154	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	1.935	100.000		1000	100,00	—
XS0222759689	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Floored	1,25	2005	—	15-VII-2020	15-VII	15-VII	34.000	2.406	100.000		1000	100,00	—
XS0222844952	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Targeted Switch	0,31	2005	—	15-VII-2020	15-VII	15-VII	78.379	1.746	100.000		1000	100,00	—
XS0212674575	BEI 2005-2020 Fixed / Index-Linked	0,74	2005	—	16-III-2020	16-III	16-III	100.000	2.769	100.000		1000	100,00	—
XS0233286078	BEI 2005-2025 Fixed / CMS-Linked con Premio al Rimborso	0,72	2005	—	18-XI-2025	18-XI	18-XI	50.000	3.037	50.000		1000	100,00	—
US298785DV50	BEI 2006-2036 4,875% USD	4,88	2006	—	15-II-2036	15-II; 15-VIII	15-II	USD 1.000.000	USD 14.176	USD1.000.000	USD	1.000	99,18	—
XS0308505055	BEI 2007-2017 4,75%	4,75	2007	—	15-X-2017	15-X	15-X	5.000.000	1.968	5.000.000		1000	99,87	—
XS0302736219	BEI 2007-2019 5,375% GBP	5,38	2007	—	07-III-2019	07-III	07-III	GBP 300.000	GBP 603	GBP3.000.000	GBP	1.000	99,43	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS0290050524	BEI 2007-2024 4,125%	4,13	2007	—	15-IV-2024	15-IV	15-IV	3.000.000	3.194	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 941	GBP 735.000	GBP 1.000	97,30	—
XS0434040167	BEI 2009-2017 4,125% GBP	4,13	2009	—	07-XII-2017	07-XII	07-XII	GBP 825.000	GBP 1.526	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	1.849	2.000.000	1000	100,76	—
XS0427291751	BEI 2009-2025 4,5% Eams	4,50	2009	—	15-X-2025	15-X	15-X	3.500.000	844	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 511	GBP 955.000	GBP 1.000	99,09	—
XS0558939269	BEI 2010-2017 2% USD	2,00	2010	—	15-XII-2017	15-VI; 15-XII	15-XII	USD 1.500.000	USD 10.128	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 685.010	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-IX	12-III	TRY 85.000	TRY 27.467	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	15-IX	USD 3.000.000	USD 8.954	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	1.258	1.750.000	1000	99,66	—
XS0505157965	BEI 2010-2030 4%	4,00	2010	—	15-IV-2030	15-IV	15-IV	3.000.000	1.431	3.000.000	1000	98,70	—
XS0694615575	BEI 2011-2018 3,75% NOK	3,75	2011	—	31-X-2018	31-X	31-X	NOK 1.750.000	NOK 28.280	NOK 1.750.000	NOK 10.000	101,03	—
XS0648456167	BEI 2011-2018 9,25% TRY	9,25	2011	—	20-VII-2018	20-VII	20-VII	TRY 100.000	TRY 457.903	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	2.034	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	1.222	3.000.000	1000	99,38	—
US298785FM34	BEI 2011-2021 4% USD	4,00	2011	—	16-II-2021	16-II; 16-VIII	16-II	USD 2.000.000	USD 14.444	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 241.080	ZAR 700.000	ZAR 10.000	100,38	—
US298785FZ47	BEI 2012-2017 1% USD	1,00	2012	—	15-XII-2017	15-VI; 15-XII	15-XII	USD 3.000.000	USD 72.435	USD 3.000.000	USD 1.000	99,74	—
XS0858481194	BEI 2012-2017 5,5% TRY	5,50	2014	—	28-XI-2017	28-XI	28-XI	TRY 700.000	TRY 208.031	TRY 700.000	TRY 1.000	100,28	—
XS0821238226	BEI 2012-2019 1,875%	1,88	2012	—	15-X-2019	15-IV; 15-X	15-X	USD 1.250.000	USD 17.204	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-IX	15-III	USD 1.500.000	USD 10.028	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 41.880	NOK 2.600.000	NOK 10.000	101,57	—
XS0773059042	BEI 2012-2019 3% SEK	3,00	2012	—	23-IV-2019	23-IV	23-IV	SEK 3.750.000	SEK 12.110	SEK 3.750.000	SEK 10.000	99,38	—
XS0848049838	BEI 2012-2019 6% ZAR	6,00	2014	—	21-X-2019	21-X	21-X	ZAR 5.500.000	ZAR 3.117.150	ZAR 5.500.000	ZAR 5.000	100,22	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS0858366098	BEI 2012-2020 1,375%	1,38	2014	—	15-IX-2020	15-IX	15-IX	2.000.000	879	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 2.453	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	1.334	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	1.811	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 28.670	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	7.801	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	512	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 542	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 464	GBP 600.000	GBP 1.000	98,28	—
XS0875343591	BEI 2013-2017 5,75% ZAR	5,75	2013	—	21-XII-2017	21-XII	21-XII	ZAR 2.450.000	ZAR 713.630	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 1.094.305	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 133.666	TRY 235.000	TRY 1.000	99,38	—
XS0878567394	BEI 2013-2018 1%	1,00	2013	—	15-VII-2017	15-VII	—	5.000.000	7.027	5.000.000	1000	99,55	—
US298785GA86	BEI 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	15-III-2018	15-III; 15-IX	15-III	USD 5.000.000	USD 30.451	USD 5.000.000	USD 1.000	99,43	—
US298785GC43	BEI 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	15-VI-2018	15-VI; 15-XII	15-VI	USD 5.000.000	USD 106.408	USD 5.000.000	USD 1.000	99,40	—
XS0872706881	BEI 2013-2018 1,375% GBP	1,38	2013	—	15-I-2018	15-I	15-I	GBP 1.000.000	GBP 11.245	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	18-XII	USD 3.000.000	USD 35.599	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-X	24-IV	CAD 500.000	CAD 14.539	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 17.200	NOK 1.600.000	NOK 10.000	101,30	—
XS0973079469	BEI 2013-2018 2,625% CAD	2,63	2013	—	24-IX-2018	24-III; 24-IX	24-IX	CAD 500.000	CAD 3.041	CAD 500.000	CAD 1.000	99,83	—
XS0935881853	BEI 2013-2018 5,25% TRY	5,25	2014	—	03-IX-2018	03-IX	03-IX	TRY 500.000	TRY 236.517	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 186.190	TRY 550.000	TRY 1.000	101,21	—
XS0889394846	BEI 2013-2018 6% RUB	6,00	2013	—	15-II-2018	15-II	15-II	RUB 5.000.000	RUB 160.200	RUB 5.000.000	RUB 50.000	101,52	—
XS0881488430	BEI 2013-2019 1,5% GBP	1,50	2013	—	01-II-2019	01-II	01-II	GBP 650.000	GBP 15.622	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 636.090	ZAR 1.550.000	ZAR 10.000	99,14	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
XS0995130712	BEI 2013-2019 8,5% TRY	8,50	2014	—	25-VII-2019	25-VII	25-VII	TRY 225.000	TRY 291.645	TRY 225.000	TRY	1.000	101,60	—
XS0888089082	BEI 2013-2020 1,625% USD	1,63	2013	—	16-III-2020	16-III; 16-IX	16-III	USD 1.250.000	USD 40.659	USD 1.250.000	USD	1.000	99,20	—
XS0882238297	BEI 2013-2020 3% NOK	3,00	2013	—	04-II-2020	04-II	04-II	NOK 1.200.000	NOK 7.170	NOK 1.200.000	NOK	10.000	101,19	—
XS0984173624	BEI 2013-2020 7,5% ZAR	7,50	2014	—	15-I-2020	15-I	15-I	ZAR 700.000	ZAR 630.240	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	635	140.000		1000	100,00	—
XS0942172296	BEI 2013-2023 2%	2,00	2013	—	14-IV-2023	14-IV	14-IV	4.000.000	2.064	4.000.000		1000	99,98	—
XS0933581802	BEI 2013-2023 3,25% NOK	3,25	2013	—	24-V-2023	24-V	24-V	NOK 750.000	NOK 11.690	NOK 750.000	NOK	10.000	100,69	—
XS0960306578	BEI 2013-2030 2,75%	2,75	2013	—	13-IX-2030	13-IX	13-IX	750.000	1.059	750.000		1000	99,93	—
XS0975634204	BEI 2013-2033 3%	3,00	2013	—	14-X-2033	14-X	14-X	3.000.000	1.434	3.000.000		1000	99,57	—
XS0878008225	BEI 2013-2035 2,625%	2,63	2014	—	15-III-2035	15-III	15-III	140.000	861	140.000		1000	99,03	—
XS0884635524	BEI 2013-2040 2,75%	2,75	2014	—	15-III-2040	15-III	15-III	170.000	775	170.000		1000	99,62	—
XS1028546916	BEI 2014-2017 0,5%	0,50	2014	—	15-IX-2017	15-IX	15-IX	850.000	1.759	850.000		1000	99,61	—
US298785GN08	BEI 2014-2017 1% USD	1,00	2014	—	17-VIII-2017	17-II; 17-VIII	17-VIII	USD 3.000.000	USD 11.433	USD 3.000.000	USD	1.000	99,71	—
XS1014703851	BEI 2014-2017 10,5% BRL	9,00	2014	—	21-XII-2017	21-XII	21-XII	BRL 1.675.000	BRL 697.330	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 68.785	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 301.345	BRL 275.000	BRL	5.000	100,73	—
XS1107496439	BEI 2014-2018 4,25% NZD	4,25	2014	—	10-IX-2018	10-IX	10-IX	NZD 125.000	NZD 24.337	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 28.735	ZAR 500.000	ZAR	5.000	100,57	—
US298785GM25	BEI 2014-2019 1,75% USD	1,75	2014	—	20-V-2019	20-V; 20-XI	—	USD 5.000.000	USD 10.340	USD 5.000.000	USD	1.000	99,58	—
US298785GH30	BEI 2014-2019 1,875% USD	1,88	2014	—	15-III-2019	15-III; 15-IX	15-III	USD 4.500.000	USD 3.112	USD 4.500.000	USD	1.000	99,47	—
XS1053090665	BEI 2014-2019 10,75% TRY	10,75	2014	—	15-XI-2019	15-XI	15-XI	TRY 100.000	TRY 87.703	TRY 100.000	TRY	1.000	101,41	—
XS1028038096	BEI 2014-2019 2,125% CAD	2,13	2014	—	04-II-2019	04-II; 04-VIII	04-II	CAD 1.200.000	CAD 8.723	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 24.730	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 28.104	NZD 125.000	NZD	1.000	101,02	—
XS1051861851	BEI 2014-2020 2,25% GBP	2,25	2014	—	08-IV-2019	08-IV	—	GBP 500.000	GBP 1.208	GBP 500.000	GBP	1.000	99,60	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS1089985557	BEI 2014-2020 4,625% NZD	4,63	2014	—	30-VII-2020	30-VII	30-VII	NZD 100.000	NZD 8.891	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 493.350	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 251.126	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 32.812	TRY 1.000.000	TRY 1.000	101,51	—
XS1044744032	BEI 2014-2021 1,5%	1,50	2014	—	15-IV-2021	15-IV	15-IV	5.000.000	520	5.000.000	1000	99,92	—
US298785GP55	BEI 2014-2021 2,125% USD	2,22	2014	—	15-X-2021	15-IV; 15-X	15-X	USD 3.000.000	USD 26.851	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-X	15-IV	USD 3.000.000	USD 6.018	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 399.565	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 319.986	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 448.655	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	1.145	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 143.950	TRY 75.000	TRY 1.000	100,53	—
US298785GQ39	BEI 2014-2024 2,5% USD	2,50	2014	—	15-X-2024	15-IV; 15-X	15-X	USD 1.000.000	USD 21.774	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-VII	29-I	USD 3.500.000	USD 15.802	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 1.180.260	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 400.538	TRY 1.000.000	TRY 1.000	98,74	—
XS1107718279	BEI 2014-2026 1,25%	1,25	2014	—	13-XI-2026	13-XI	13-XI	750.000	1.967	750.000	1000	98,74	—
XS1107247725	BEI 2014-2045 1,75%	1,75	2014	—	15-IX-2045	15-IX	15-IX	500.000	2.416	500.000	1000	97,22	—
US298785GW07	BEI 2015-2018 1,125% USD	1,13	2015	—	15-VIII-2018	15-II; 15-VIII	15-VIII	USD 3.000.000	USD 15.569	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-XI	15-V	USD 4.000.000	USD 6.367	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 100.950	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	3.881	500.000	1000	99,50	—
XS1288040055	BEI 2015-2020 0,25%	0,25	2015	—	15-X-2020	15-X	15-X	3.000.000	2.545	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 229.410	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-XII	15-VI	USD 5.000.000	USD 36.418	USD 5.000.000	USD 1.000	99,43	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
US298785GR12	BEI 2015-2020 1,625% USD	1,63	2015	—	16-III-2020	16-III; 16-IX	16-III	USD 4.000.000	USD 5.341	USD4.000.000	USD	1.000	99,75	—
US298785GY62	BEI 2015-2020 1,625% USD	1,63	2015	—	15-XII-2020	15-VI; 15-XII	15-XII	USD 4.000.000	USD 15.649	USD4.000.000	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 2.190.467	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 184.511	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	1.677	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 220.180	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	15-VIII	USD 3.000.000	USD 13.744	USD3.000.000	USD	1.000	99,51	—
XS1280834992	BEI 2015-2023 0,5%	0,50	2015	—	15-XI-2023	15-XI	15-XI	600.000	1.807	600.000		1000	99,89	—
XS1179347999	BEI 2015-2023 7,25% ZAR	7,25	2015	—	28-II-2023	28-II	28-II	ZAR 500.000	ZAR 492.030	ZAR 500.000	ZAR	5.000	100,55	—
XS1207449684	BEI 2015-2025 0,125% Earns	0,13	2015	—	15-IV-2025	15-IV	15-IV	2.000.000	7.960	2.000.000		1000	95,97	—
XS1171476143	BEI 2015-2025 1,25% SEK	1,25	2015	—	12-V-2025	12-V	12-V	SEK 2.600.000	SEK 58.880	SEK 2.600.000	SEK	10.000	99,05	—
US298785GS94	BEI 2015-2025 1,875% USD	1,88	2015	—	10-II-2025	10-II; 10-VIII	10-II	USD 3.000.000	USD 73.341	USD3.000.000	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 162.440	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 2.007.765	ZAR1.000.000	ZAR	5.000	100,52	—
XS1183208328	BEI 2015-2031 1% Ecoop	1,00	2015	—	14-III-2031	14-III	14-III	1.000.000	5.567	1.000.000		1000	99,85	—
XS1434092364	BEI 2016-2016 Fixed Step Up Callable USD	1,00	2016	—	10-VIII-2026	10-VIII	10-VIII	USD 136.500	USD 28.962	USD 136.500	USD	2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato a partire dal 10-VIII-2021, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
XS1350662737	BEI 2016-2019 0%	—	2016	—	15-I-2019	15-I	15-I	5.000.000	1.347	5.000.000		1000	100,44	—
US298785HE99	BEI 2016-2019 1,125% USD	1,13	2016	—	15-VIII-2019	15-II; 15-VIII	15-VIII	USD 3.000.000	USD 20.025	USD3.000.000	USD	1.000	99,98	—
US298785HB50	BEI 2016-2019 1,25% USD	1,25	2016	—	15-V-2019	15-V; 15-XI	15-V	USD 4.000.000	USD 7.626	USD4.000.000	USD	1.000	99,81	—
US298785HG48	BEI 2016-2019 1,25% USD	1,25	2016	—	16-XII-2019	16-VI; 16-XII	16-XII	USD 4.500.000	USD 11.191	USD4.500.000	USD	1.000	99,91	—
XS1374123732	BEI 2016-2019 11,5% BRL	11,50	2016	—	11-III-2019	11-III	11-III	BRL 150.000	BRL 117.220	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 128.685	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 40.690	ZAR1.000.000	ZAR	5.000	100,75	—
XS1394753484	BEI 2016-2021 1% NOK	1,00	2016	—	25-V-2021	25-V	25-V	NOK 1.000.000	NOK 115.190	NOK1.000.000	NOK	10.000	101,19	—
XS1416470323	BEI 2016-2021 1,125% GBP	1,13	2016	—	07-IX-2021	07-IX	07-IX	GBP 1.000.000	GBP 13.176	GBP1.000.000	GBP	1.000	99,39	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLI	Interesse %	Anno emissione	Data		Scadenza cedole	Data dei rimborsi
				Primo rimborso	Ultimo rimborso		
US298785HF64	BEI 2016-2021 1,375% USD	1,38	2016	—	15-IX-2021	15-III; 15-IX	15-IX
US298785HC34	BEI 2016-2021 1,625% USD	1,63	2016	—	15-VI-2021	15-VI; 15-XII	15-VI
US298785HA77	BEI 2016-2021 2% USD	2,00	2016	—	15-III-2021	15-III; 15-IX	15-III
XS1342860167	BEI 2016-2021 4,75% MXN	4,75	2016	—	19-I-2021	19-I	19-I
XS1489409679	BEI 2016-2023 0%	—	2016	—	16-X-2023	16-X	16-X
XS1524609531	BEI 2016-2023 5,5% MXN	5,50	2016	—	23-I-2023	23-I	23-I
XS1515221064	BEI 2016-2024 Step-Up Callable AUD ¹⁾	1,50	2016	—	13-XII-2024	13-XII	13-XII
XS1388868165	BEI 2016-2024 Zero Coupon TRY	—	2016	—	05-IV-2024	—	05-IV
XS1394055872	BEI 2016-2026 0,375% Earns	0,38	2016	—	14-IV-2026	14-IV	14-IV
XS1490724975	BEI 2016-2026 1% GBP	1,00	2016	—	21-IX-2026	21-IX	21-IX
XS1507486584	BEI 2016-2026 1,5% USD Callable	1,50	2016	—	21-XI-2026	21-XI	21-XI
US298785HD17	BEI 2016-2026 2,125% USD	2,13	2016	—	13-IV-2026	13-IV; 13-X	13-IV
XS1398573136	BEI 2016-2026 Callable Step-Up Fixed Rate ²⁾	1,10	2016	—	31-V-2026	31-V	31-V
XS1486060640	BEI 2016-2026 Callable Step-Up Fixed Rate USD ³⁾	1,00	2016	03-X-2017	03-X-2026	03-X	03-X
XS1503043694	BEI 2016-2029 0,25%	0,25	2016	—	14-IX-2029	14-IX	14-IX
XS1422953932	BEI 2016-2032 1% Earns	1,00	2016	—	14-IV-2032	14-IV	14-IV
XS1361554584	BEI 2016-2036 1,125%	1,13	2016	—	15-IX-2036	15-IX	15-IX
XS1500338618	BEI 2016-2037 0,5%	0,50	2016	—	13-XI-2037	13-XI	13-XI
XS1505567088	BEI 2016-2047 0,875%	0,88	2016	—	13-IX-2047	13-IX	13-IX
XS1550273046	BEI 2017-2019 8,75% BRL	8,75	2017	—	23-I-2019	23-I	23-I
XS1548413696	BEI 2017-2020 0,625% GBP	0,63	2017	—	17-I-2020	17-I	17-I
US298785HJ86	BEI 2017-2020 1,75% USD	1,75	2017	—	15-V-2020	15-V; 15-XI	15-V

Importo in circolazione al 30-VI-2016 (migliaia di euro)	Quantità nominali trattate dall'1-VII-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Prezzo di emissione %	Note sulle modalità di rimborso
USD 3.500.000	USD 7.609	USD3.500.000	USD 1.000	99,85	—
USD 3.500.000	USD 7.792	USD3.500.000	USD 1.000	100,00	—
USD 4.500.000	USD 9.676	USD4.500.000	USD 1.000	99,80	—
MXN 1.000.000	MXN 1.386.830	MXN 1.000.000	MXN 10.000	99,35	—
4.000.000	948	4.000.000	1000	101,70	—
MXN 500.000	MXN 612.634	MXN 500.000	MXN 1.000	96,00	—
AUD 60.000	AUD 15.750	AUD 60.000	AUD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 13-XII-2021, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
TRY 250.000	TRY 19.013	TRY 250.000	TRY 1.000	44,55	—
5.000.000	3.994	5.000.000	1000	100,00	—
GBP 500.000	GBP 2.707	GBP 500.000	GBP 1.000	99,41	—
USD 298.856	USD 11.082	USD 298.856	USD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 21-XI-2021, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
USD 1.500.000	USD 14.205	USD1.500.000	USD 1.000	100,00	—
USD 204.000	USD 71.414	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.
USD 40.000	USD 6.776	USD 40.000	USD 2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 3-X-2021, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
500.000	851	500.000	1000	100,00	—
3.000.000	4.085	3.000.000	1000	99,74	—
500.000	4.482	500.000	1000	97,98	—
500.000	4.763	500.000	1000	97,75	—
500.000	3.412	500.000	1000	96,74	—
BRL 100.000	BRL 127.230	BRL 100.000	BRL 5.000	99,71	—
GBP 1.000.000	GBP 802	GBP1.000.000	GBP 1.000	100,00	—
USD 3.000.000	USD 1.221	USD3.000.000	USD 1.000	99,71	—

1) Cedole fisse crescenti rispettivamente pari al 1,50%, 1,75, 2,00%, 2,15%, 2,30%, 2,50%, 3,00% e 3,25%. - 2) 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%. - 3) Cedole fisse crescenti rispettivamente pari al 1,00%, 1,00, 1,20%, 1,20%, 1,40%, 1,40%, 1,60%, 1,60%, 1,80% e 1,80%.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS1555155388	BEI 2017-2020 7% MXN	7,00	2017	—	27-VII-2020	27-VII	27-VII	MXN 1.000.000	MXN 255.570	MXN1.000.000	MXN 10.000	99,00	—
XS1626936543	BEI 2017-2020 8% BRL	8,00	2017	—	09-VI-2020	09-VI	09-VI	BRL 100.000	BRL 16.015	BRL 100.000	BRL 5.000	100,00	—
XS1550952292	BEI 2017-2020 8,5% BRL	8,50	2017	—	23-I-2020	23-I	23-I	BRL 175.000	BRL 123.305	BRL 175.000	BRL 5.000	98,74	—
XS1551293019	BEI 2017-2022 0,5% SEK	0,50	2017	—	19-VII-2022	19-VII	19-VII	SEK 3.000.000	SEK 6.320	SEK3.000.000	SEK 10.000	100,00	—
XS1574041999	BEI 2017-2022 10% TRY	10,00	2017	—	07-III-2022	07-III	07-III	TRY 150.000	TRY 62.858	TRY 150.000	TRY 1.000	99,13	—
US298785HH21	BEI 2017-2022 2,25% USD	2,25	2017	—	15-III-2022	15-III; 15-IX	15-III	USD 4.000.000	USD 3.634	USD4.000.000	USD 1.000	100,00	—
US298785HK59	BEI 2017-2022 2,375% USD	2,38	2017	—	15-VI-2022	15-VI; 15-XII	15-VI	USD 3.000.000	USD 1.309	USD3.000.000	USD 1.000	100,00	—
XS1551068080	BEI 2017-2022 7,5% MXN	7,50	2017	—	09-VI-2022	09-VI	09-VI	MXN 1.000.000	MXN 15.296	MXN1.000.000	MXN 1.000	100,85	—
XS1555330999	BEI 2017-2024 1,5% NOK	1,50	2017	—	26-I-2024	26-I	26-I	NOK 1.000.000	NOK 51.660	NOK1.000.000	NOK 10.000	98,89	—
XS1555331617	BEI 2017-2027 0,5% Earns	0,50	2017	—	15-I-2027	15-I	15-I	5.000.000	1.472	5.000.000	1000	98,96	—
US298785HM16	BEI 2017-2027 2,375% USD	2,38	2017	—	24-V-2033	24-V; 24-XI	24-V	USD 1.500.000	USD 901	USD1.500.000	USD 1.000	98,92	—
XS1588672144	BEI 2017-2027 6,5% MXN	6,50	2017	—	07-VII-2027	07-VII	07-VII	MXN 1.000.000	MXN 152.434	MXN1.000.000	MXN 1.000	96,05	—
XS1547492410	BEI 2017-2027 8% MXN	8,00	2017	—	11-I-2027	11-I	11-I	MXN 500.000	MXN 172.531	MXN 500.000	MXN 1.000	100,86	—
XS1605368536	BEI 2017-2027 8% ZAR	8,00	2017	—	05-V-2027	05-V	05-V	ZAR 500.000	ZAR 20.235	ZAR 500.000	ZAR 5.000	97,76	—
XS1566126345	BEI 2017-2027 Zero Coupon TRY	—	2017	—	16-II-2027	—	16-II	TRY 300.000	TRY 4.849	TRY 300.000	TRY 1.000	39,88	—
XS0080713497	BERS 1997-2027 Zero Coupon ZAR	—	1997	—	30-XII-2027	—	30-XII	ZAR 3.000.000	ZAR 98.800	ZAR3.000.000	ZAR 50.000	3,31	—
IT0006526153	BERS 1998-2018 Step-Down Lifestyle	—	1998	—	18-XII-2018	18-XII	18-XII	64.717	862	77.468	5000000	100,00	—
XS0085289428	BERS 1998-2020 Zero Coupon ZAR	—	1998	—	31-XII-2020	—	31-XII	ZAR 911.800	ZAR 17.600	ZAR 911.800	ZAR 50.000	7,17	—
IT0006527078	BERS 1999-2024 Step-Down Lifestyle	—	1999	—	05-II-2024	05-II	05-II	150.000	1.571	150.000	1000	100,00	—
IT0006592981	BERS 2005-2025 CMS-Linked Global Floor	0,32	2005	—	22-VII-2025	22-VII	22-VII	74.000	8.728	75.000	1000	100,00	—
US29874QCF90	BERS 2012-2017 0,75% USD	0,75	2012	—	01-IX-2017	01-III; 01-IX	01-IX	USD 1.700.000	USD 2.686	USD1.700.000	USD 1.000	99,57	—
US29874QCJ13	BERS 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	15-VI-2018	15-VI; 15-XII	15-VI	USD 1.000.000	USD 3.141	USD1.000.000	USD 1.000	99,93	—
US29874QCK85	BERS 2013-2018 1% USD	1,00	2013	—	17-IX-2018	17-III; 17-IX	17-IX	USD 1.250.000	USD 2.825	USD1.250.000	USD 1.000	99,91	—
US29874QCL68	BERS 2013-2018 1,625% USD	1,63	2013	—	15-XI-2018	15-V; 15-XI	15-XI	USD 1.750.000	USD 650	USD1.750.000	USD 1.000	99,58	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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								
XS0963725311	BERS 2013-2018 4,5% MXN	4,50	2013	—	18-XII-2018	18-XII	18-XII	MXN 650.000	MXN 152.517	MXN 650.000	MXN 1.000	99,48	—
US29874QCH56	BERS 2013-2020 1,5% USD	1,50	2013	—	16-III-2020	16-III; 16-IX	16-III	USD 1.425.000	USD 5.623	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 42.394	TRY 175.000	TRY 1.000	101,23	—
US29874QCT94	BERS 2015-2022 1,875% USD	1,88	2015	—	23-II-2022	23-II; 23-VIII	23-II	USD 1.000.000	USD 3.229	USD 1.000.000	USD 1.000	99,73	—
US29874QCX07	BERS 2016-2020 1,125% USD	1,13	2016	—	24-VIII-2020	24-II; 24-VIII	24-VIII	USD 1.250.000	USD 545	USD 1.250.000	USD 1.000	99,58	—
XS1349367547	BERS 2016-2026 Zero Coupon RUB	—	2016	—	22-I-2026	—	22-I	RUB 4.250.000	RUB 248.600	RUB 4.250.000	RUB 50.000	45,50	—
XS1602480508	BERS 2017-2018 8% RUB	8,00	2017	—	26-IV-2018	26-IV	26-IV	RUB 5.000.000	RUB 345.300	RUB 5.000.000	RUB 50.000	99,77	—
XS1578094317	BERS 2017-2019 7,5% BRL	7,50	2017	—	16-XII-2019	16-XII	16-XII	BRL 150.000	BRL 19.610	BRL 150.000	BRL 5.000	98,62	—
US459056LD78	BIRS 1993-2023 7,625% USD	7,63	1993	—	19-I-2023	19-I; 19-VII	19-I	USD 1.250.000	USD 4.034	USD 1.250.000	USD 1.000	99,49	—
US45905UAH77	BIRS 1997-2017 ZAR Zero Coupon	—	1997	—	29-XII-2017	—	29-XII	ZAR 2.367.000	ZAR 17.730	ZAR 2.367.000	ZAR 5.000	8,40	—
XS0320606840	BIRS 2007-2022 Zero Coupon MXN	—	2007	—	19-IX-2022	—	19-IX	MXN 1.850.000	MXN 28.920	MXN 1.850.000	MXN 10.000	33,98	—
XS0429114530	BIRS 2009-2019 3,875%	3,88	2009	—	20-V-2019	20-V	20-V	3.000.000	1.055	3.000.000	1000	99,37	—
XS1264244697	BIRS 2015-2018 9,625% TRY	9,63	2015	—	13-VII-2018	13-VII	13-VII	TRY 150.000	TRY 12.860	TRY 150.000	TRY 10.000	101,01	—
XS1198732668	BIRS 2015-2019 10% RUB	10,00	2015	—	16-IX-2019	16-IX	16-IX	RUB 6.000.000	RUB 110.200	RUB 6.000.000	RUB 100.000	98,40	—
XS1218809389	BIRS 2015-2030 0,5%	0,50	2015	—	16-IV-2030	16-IV	16-IV	600.000	1.170	600.000	1000	99,63	—
US459058FE81	BIRS 2016-2018 0,875% USD	0,88	2016	—	19-VII-2018	19-I; 19-VII	19-VII	USD 5.000.000	USD 2.207	USD 5.000.000	USD 1.000	99,82	—
XS1476750622	BIRS 2016-2018 8% RUB	8,00	2016	—	22-VIII-2018	22-VIII	22-VIII	RUB 8.250.000	RUB 410.300	RUB 8.250.000	RUB 50.000	98,95	—
US459058FK42	BIRS 2016-2019 0,875% USD	0,88	2016	—	15-VIII-2019	15-II; 15-VIII	15-VIII	USD 5.000.000	USD 1.995	USD 5.000.000	USD 1.000	99,98	—
US459058EV16	BIRS 2016-2019 1,25% USD	1,25	2016	—	26-VII-2019	26-I; 26-VII	26-VII	USD 4.500.000	USD 5.045	USD 4.500.000	USD 1.000	99,52	—
XS1503155068	BIRS 2016-2019 5,25% MXN	5,25	2016	—	17-X-2019	17-X	17-X	MXN 1.200.000	MXN 39.800	MXN 1.200.000	MXN 10.000	99,60	—
XS1488416592	BIRS 2016-2019 6,6% ZAR	6,60	2016	—	26-IX-2019	26-III; 26-VI; 26-IX; 26-XII	26-IX	ZAR 250.000	ZAR 334.520	ZAR 250.000	ZAR 40.000	100,00	—
XS1508503809	BIRS 2016-2019 6,80% TRY	6,80	2016	—	16-XI-2019	16-II; 16-V; K 16-VIII; 16-XI	16-XI	TRY 30.000	TRY 49.328	TRY 30.000	TRY 8.000	100,00	—
US459058FM08	BIRS 2016-2020 1,125% USD	1,75	2016	—	10-VIII-2020	10-II; 10-VIII	10-VIII	USD 1.500.000	USD 3.096	USD 1.500.000	USD 1.000	99,93	—
US459058FA69	BIRS 2016-2020 1,375% USD	1,38	2016	—	30-III-2020	30-III; 30-IX	30-III	USD 3.000.000	USD 2.636	USD 3.000.000	USD 1.000	99,67	—
XS1523974027	BIRS 2016-2020 7,25% RUB	7,25	2016	—	23-XI-2020	23-XI	23-XI	RUB 4.250.000	RUB 329.700	RUB 4.250.000	RUB 100.000	100,85	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
US459058FH13	BIRS 2016-2021 1,375% USD	1,38	2016	—	24-V-2021	24-V; 24-XI	24-V	USD 5.000.000	USD 3.633	USD5.000.000	USD	1.000	99,74	—
US459058FP39	BIRS 2016-2021 1,375% USD	1,38	2016	—	20-IX-2021	20-III; 20-IX	20-IX	USD 3.500.000	USD 1.100	USD3.500.000	USD	1.000	100,00	—
US459058EW98	BIRS 2016-2021 1,625% USD	1,63	2016	—	09-III-2021	09-III; 09-IX	09-III	USD 4.000.000	USD 1.407	USD4.000.000	USD	1.000	99,85	—
XS1442211923	BIRS 2016-2021 2,5% CNY	2,50	2016	—	22-VII-2021	22-VII	22-VII	CNY 95.000	CNY 128.730	CNY 120.000	CNY	10.000	100,00	—
XS1442212145	BIRS 2016-2021 5,8% INR	5,80	2016	—	22-VII-2021	22-VII	22-VII	INR 3.300.000	INR 3.885.750	INR 3.300.000	INR	150.000	100,00	—
US459058FF56	BIRS 2016-2023 1,75% USD	1,75	2016	—	19-IV-2023	19-IV; 19-X	19-IV	USD 1.000.000	USD 3.765	USD1.000.000	USD	1.000	99,99	—
XS1365236196	BIRS 2016-2026 1,75% USD Callable	1,75	2016	—	29-III-2026	29-III; 29-IX	29-III	USD 200.000	USD 73.112	USD 200.000	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	1,29	2016	—	28-VI-2026	28-VI	28-VI	USD 116.000	USD 35.110	USD 120.000	USD	2.000	100,00	—
XS1488416329	BIRS 2016-2049 7,6% BRL	7,60	2016	—	26-IX-2019	26-III; 26-VI; 26-IX; 26-XII	26-IX	BRL 180.000	BRL 298.480	BRL 180.000	BRL	10.000	100,00	—
XS1576699075	BIRS 2017-2020 10% TRY	10,00	2017	—	16-III-2020	16-III	16-III	TRY 100.000	TRY 13.273	TRY 100.000	TRY	1.000	97,40	—
XS1593538694	BIRS 2017-2020 6,65% BRL	6,65	2017	—	28-IV-2020	28-IV	28-IV	BRL 20.000	BRL 41.290	BRL 20.000	BRL	10.000	100,00	—
XS1562153848	BIRS 2017-2021 7,125% MXN	7,13	2017	—	09-II-2021	09-II	09-II	MXN 500.000	MXN 22.020	MXN 500.000	MXN	10.000	101,42	—
XS1619315861	BIRS 2017-2021 7,5% BRL	7,50	2017	—	09-VI-2021	09-VI	09-VI	BRL 150.000	BRL 7.055	BRL 150.000	BRL	5.000	100,00	—
XS1558422371	BIRS 2017-2022 1% NOK	1,00	2017	—	02-II-2022	02-II	02-II	NOK 1.000.000	NOK 67.790	NOK1.000.000	NOK	10.000	100,10	—
US459058FY46	BIRS 2017-2022 2% USD	2,00	2017	—	26-I-2022	26-I; 26-VII	26-I	USD 5.000.000	USD 793	USD5.000.000	USD	1.000	99,46	—
XS1609294308	BIRS 2017-2027 2,25% USD Callable	2,25	2017	—	22-V-2027	22-V	22-V	USD 20.000	USD 14.282	USD 20.000	USD	2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 22-V-2022, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
XS1550144668	BIRS 2017-2027 3% AUD	3,00	2017	—	06-II-2027	06-II; 06-V; 06-VIII; 06-XI	06-II	AUD 50.000	AUD 54.168	AUD 50.000	AUD	2.000	100,00	—
XS1550135088	BIRS 2017-2027 3,6% NZD	3,60	2017	—	06-II-2027	06-II; 06-V; 06-VIII; 06-XI	06-II	NZD 65.000	NZD 63.750	NZD 65.000	NZD	2.000	100,00	—
XS1586710698	BIRS 2017-2027 USD Callable Step-Up Fixed ¹⁾	1,90	2017	—	05-V-2027	05-V	05-V	USD 44.000	USD 4.096	USD 44.000	USD	2.000	100,00	Facoltà di rimborso anticipato ad ogni data di pagamento delle cedole a partire dal 5-V-2022, con preavviso di almeno 5 giorni lavorativi.
IT0006527516	Council of Europe Development Bank 1999-2019 Step-Down Premio Fisso al Rimborso	—	1999	—	15-III-2019	15-III	15-III	90.000	1.843	90.000	1000	100,00	—	

1) Cedole fisse crescenti rispettivamente pari al 1,90%, 2,00%, 2,10, 2,20%, 2,30%, 2,40%, 2,50%, 2,60%, 2,70% e 2,80%.

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
IT0006527185	Council of Europe Development Bank 1999-2024 Step-Down Premio Fisso al Rimborso	—	1999	—	26-II-2024	26-II	26-II	125.000	1.308	125.000	1000	100,00	—	
IT0006596909	Council of Europe Development Bank 2005-2025 Flippable CMS-Linked	0,02	2005	—	17-X-2025	17-X	17-X	50.000	3.917	50.000	1000	100,00	—	
EU000A1G0AR0	EFSF 2012-2019 2,625%	2,63	2012	—	02-V-2019	02-V	02-V	3.000.000	697	3.000.000	1000	99,82	—	
EU000A1G0DD4	EFSF 2015-2045 1,2%	1,20	2015	—	17-II-2045	17-II	17-II	1.500.000	10.024	1.500.000	1000	99,28	—	
EU000A1G0DH5	EFSF 2016-2026 0,4%	0,40	2016	—	31-V-2026	31-V	31-V	3.000.000	663	3.000.000	1000	99,10	—	
EU000A1G0DJ1	EFSF 2016-2047 1,375%	1,38	2016	—	31-V-2047	31-V	31-V	2.000.000	713	2.000.000	1000	98,78	—	
EU000A1G0DN3	EFSF 2017-2056 2%	2,00	2017	—	28-II-2056	28-II	28-II	1.000.000	516	1.000.000	1000	100,64	—	
EU000A1A1DJ5	European Union 2010-2017 2,375%	2,38	2010	—	22-IX-2017	22-IX	22-IX	1.150.000	622	1.150.000	1000	99,87	—	
EU000A1GV187	European Union 2011-2018 2,375%	2,38	2011	—	04-X-2018	04-X	04-X	1.100.000	1.864	1.100.000	1000	99,38	—	
EU000A1GN002	European Union 2011-2018 3,25%	3,25	2011	—	04-IV-2018	04-IV	04-IV	4.600.000	514	4.600.000	1000	99,96	—	
EU000A1GVJX6	European Union 2011-2021 2,75%	2,75	2011	—	21-IX-2021	21-IX	21-IX	5.000.000	1.780	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	4.073	2.700.000	1000	99,63	—	
XS1313203298	IFC 2015-2020 11,5% BRL	11,50	2015	—	30-X-2020	30-X	30-X	BRL 200.000	BRL 7.895	BRL 200.000	BRL	5.000	97,38	—
XS1349365764	IFC 2016-2019 12% BRL	12,00	2016	—	29-I-2019	29-I	29-I	BRL 100.000	BRL 67.900	BRL 100.000	BRL	5.000	99,23	—
XS1559528903	IFC 2017-2020 6,75% RUB	6,75	2017	—	03-II-2020	03-II	03-II	RUB 1.500.000	RUB 1.427.900	RUB 1.500.000	RUB	50.000	98,69	—
XS1559906356	IFC 2017-2021 11% TRY	11,00	2017	—	03-II-2021	03-II	03-II	TRY 100.000	TRY 14.610	TRY 100.000	TRY	10.000	98,30	—
XS1608102973	IFC 2017-2022 7,5% BRL	7,50	2017	—	09-V-2022	09-V	09-V	BRL 225.000	BRL 2.875	BRL 225.000	BRL	5.000	96,95	—
IT0006596701	World Bank 2005-2025 CMS-Linked Global Floor	0,25	2005	—	07-X-2025	07-X	07-X	75.000	5.798	75.000	1000	100,00	—	
US45905CAA27	World Bank 2005-2035 4,75% USD	4,75	2005	—	15-II-2035	15-II; 15-VIII	15-II	USD 750.000	USD 1.455	USD 750.000	USD	1.000	98,96	—
US459058DC44	World Bank 2013-2017 1,125% USD	1,13	2013	—	18-VII-2017	18-I; 18-VII	18-VII	USD 1.750.000	USD 1.230	USD1.750.000	USD	1.000	99,72	—
US459058CY72	World Bank 2013-2023 2,125% USD	2,13	2013	—	13-II-2023	13-II; 13-VIII	13-II	USD 750.000	USD 4.906	USD 750.000	USD	1.000	99,42	—
US459058DN09	World Bank 2014-2018 1,375% USD	1,38	2014	—	10-IV-2018	10-IV; 10-X	10-IV	USD 3.300.000	USD 1.576	USD3.300.000	USD	1.000	99,62	—
US459058DW08	World Bank 2014-2019 1,875% USD	1,88	2014	—	07-X-2019	07-IV; 07-X	07-X	USD 4.000.000	USD 729	USD4.000.000	USD	1.000	99,85	—
US459058DT78	World Bank 2014-2021 2,25% USD	2,25	2014	—	24-VI-2021	24-VI; 24-XII	24-VI	USD 2.000.000	USD 2.957	USD2.000.000	USD	1.000	99,39	—

TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (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									
US459058EM17	World Bank 2015-2017 1% USD	1,00	2015	—	15-XI-2017	15-V; 15-XI	15-XI	USD 3.500.000	USD 1.450	USD3.500.000	USD	1.000	99,99	—
US459058EJ87	World Bank 2015-2018 1% USD	1,00	2015	—	15-VI-2018	15-VI; 15-XII	15-VI	USD 5.000.000	USD 1.931	USD5.000.000	USD	1.000	99,83	—
US459058ER04	World Bank 2015-2018 1% USD	1,00	2015	—	05-X-2018	05-IV; 05-X	05-X	USD 4.000.000	USD 8.456	USD4.000.000	USD	1.000	99,83	—
US459058DY63	World Bank 2015-2022 1,625% USD	1,63	2015	—	10-II-2022	10-II; 10-VIII	10-II	USD 4.000.000	USD 3.237	USD4.000.000	USD	1.000	99,87	—
US459058ES86	World Bank 2015-2022 1,875% USD	1,88	2015	—	07-X-2022	07-IV; 07-X	07-X	USD 1.250.000	USD 5.600	USD1.250.000	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 22.068	TRY 50.000	TRY	1.000	98,72	—
XS1233613188	World Bank 2015-2023 linked to the Ethical Europe Equity Index ¹⁾	1,75	2015	—	29-VI-2023	29-VI	—	USD 83.540	USD 12.410	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-IX	03-III	USD 600.000	USD 4.624	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	29-VII	USD 3.500.000	USD 3.399	USD3.500.000	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 2017
AND BONDS AT 30th JUNE 2017

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-2016 al 30-VI-2017 (migliaia di euro)	Importo nominale emesso (migliaia di euro)	Valore nominale unitario (in euro)	Modalità di conversione	Note sulle modalità di rimborso
IT0004982770	CONVERTIBILI IN AZIONI CHL 2014-2018 6% Convertibile Amortizing ¹⁾	6,00	2014	30-VI-2018	30-VI	3.037	863,29	10.228	0,20	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 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. Nel corso della conversione del VI-2017 non si è provveduto alla conversione di tutte le obbligazioni.

¹⁾ 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		
IT0004652175 IT0004716319 IT0004922909 IT0005009839 IT0005056541 IT0005104473 IT0005137614 IT0005185456 IT0005218968 IT0005252520	C.C.T.eu 2010-2017 em. 27-X-10 » 2011-2018 em. 2-V-11. » 2013-2018 em. 1-V-13. » 2013-2019 em. 1-IV-14. » 2014-2020 em. 1-X-14. » 2014-2022 em. 15-XII-14. » 2015-2022 em. 15-VI-15. » 2016-2023 em. 2-V-16. » 2016-2024 em. 1-XI-16. » 2017-2024 em. 2-V-17.	Interessi semestrali pari all'Euribor a 6 mesi maggiorato, rispettivamente, dello 0,8%, 1%, 1,8%, 1,2%, 0,8%, 0,55%, 0,7%, 0,7%, 0,75% e 1,1% 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.
IT0003745541 IT0004085210 IT0004243512 IT0004380546 IT0004604671 IT0004735152 IT0004890882 IT0005004426 IT0005138828 IT0005246134	BTPei 2004-2035 2,35% » 2006-2017 2,10%. » 2007-2023 2,60%. » 2008-2019 2,35%. » 2010-2021 2,10%. » 2011-2026 3,10%. » 2013-2018 1,70%. » 2014-2024 2,35%. » 2015-2032 1,25%. » 2016-2028 1,30%	Interessi semestrali indicati rispettivamente pari al 2,35%, 2,1%, 2,6%, 2,35%, 2,1%, 3,1%, 1,7%, 2,35%, 1,25% e 1,30% su base annua. Il rimborso del capitale e il pagamento degli interessi sono indicizzati alla 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.
IT0004969207 IT0005012783 IT0005058901 IT0005105843 IT0005174906 IT0005188120 IT0005217770 IT0005253676	BTP Italia 2013-2017 2,15% » 2014-2020 1,65%. » 2014-2020 1,25%. » 2015-2023 0,50%. » 2016-2024 0,40%. » 2016-2022 0,10%. » 2016-2024 0,35%. » 2017-2023 0,45%.	Interessi semestrali indicati rispettivamente pari al 2,15%, 1,65%, 1,25%, 0,50%, 0,40%, 0,10%, 0,35% e 0,45% 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").
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%.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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-tabacco nei Paesi dell'Area Euro mensile. Premio al rimborso pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tabacco 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-tabacco nei Paesi dell'Area Euro mensile. Premio al rimborso pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tabacco 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-tabacco nei Paesi dell'Area Euro mensile. Premio al rimborso pari al prodotto tra il valore nominale e l'HICP ex-tabacco nei Paesi dell'Area Euro mensile.
GR0338001531	GGBei 2002-2025 2,9%	Interessi annuali pari al 2,9%. Il rimborso del capitale e il pagamento degli interessi sono indicizzati alla variazione dell'indice armonizzato dei prezzi al consumo per l'area Euro (escluso il tabacco), tra la data di godimento del titolo e quella di pagamento della cedola.
FR0000188799	OATei 2002-2032 3,15%	Interessi annuali pari rispettivamente al 3,15%, 2,25%, 1,8%, 1,1%, 0,25%, 0,7% e 0,1% 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.

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
FR0010050559 FR0010447367 FR0010899765 FR0011237643 FR0011427848 FR0011982776 FR0013209871	OATei 2003-2020 2,25%. » 2006-2040 1,8%. » 2009-2022 1,1%. » 2011-2018 0,25%. » 2012-2024 0,25%. » 2013-2030 0,7%. » 2016-2047 0,1%.	
FR0000186413 FR0010235176 FR0000186413 FR0010585901 FR0010850032	OATi 1999-2029 3,4% » 2005-2017 1%. » 1999-2029 3,4%. » 2007-2023 2,1%. » 2009-2019 1,3%.	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	Obligacionesei 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.
XS0224227313	Repubblica Ellenica 2005-2020 CMS-Linked Global Floor con Opzione Flip	A partire dalla terza cedola interessi annuali pari a quattro volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni, rilevato due giorni lavorativi antecedenti la data di godimento della cedola. Nessuna cedola potrà essere negativa o superare il 7%; la somma delle cedole pagate non potrà superare il 30%. L'ultima cedola sarà pari all'eventuale differenza tra 30% e la somma delle cedole pagate precedentemente. Dal 2007, ad ogni data di pagamento degli interessi variabili, l'emittente ha la facoltà di convertire il tasso d'interesse nell'Euribor a 12 mesi maggiorato dello 0,30%.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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.
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.

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 ENTI E SOCIETÀ		
IT0005066151	Antin Solar Investments 2014-2028 Tasso Variabile	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread del 3,35%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005222283	Azienda Solare Italiana 2016-2030 Tasso Variabile Amortizing Callable	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 2,50%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
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.
IT0004906308	Banca IMI 2013-2019 Tasso Misto Cap&Floor	Dalla terza cedola interessi semestrali par al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread del 2%, con floor 2% e cap 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 spread dell'1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
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 spread 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 spread 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 spread dello 0,75%. 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
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 spread 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 spread 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 spread 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 spread dello 0,3% con cap 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 spread dello 0,6% con cap 2,20% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1490786735	Banca IMI 2016-2022 Collezione Tasso Misto Serie V USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 1% con cap 3,6% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1490787113	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto Serie III	Dalla terza cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,6% con cap 3% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1522284576	Banca IMI 2016-2026 Collezione Tasso Misto Serie II GBP	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso GBP Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dell' 1% con cap 3% annuo. 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
XS1551929760	Banca IMI 2017-2027 Collezione Tasso Misto Serie IV	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,6% con <i>cap</i> 2,70% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1555142568	Banca IMI 2017-2023 Collezione Tasso Misto Serie VI USD	Dalla quarta cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 1,50% con <i>cap</i> 3,75%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1608207566	Banca IMI 2017-2027 Collezione Tasso Misto Serie V	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,5% con <i>cap</i> 3,40% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1608207640	Banca IMI 2017-2025 Collezione Tasso Misto Serie VII USD	Dalla quarta cedola interessi annuali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1% con <i>cap</i> 4%. 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.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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.
IT0003853568	Cap Holding 2005-2019 Tasso Variabile Amortizing	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,40%. Parametro di indicizzazione rilevato il decimo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005030314	CDP 2014-2017 Tasso Variabile	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.
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%; – 25% del valore nominale qualora la suddetta media sia almeno una volta superiore 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
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.
XS1009465136	Cogemat 2014-2019 Tasso Variabile	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 9,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1009589968	Cogemat 2014-2019 Tasso Variabile	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 9,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo 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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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%.
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.
IT0005031346	Enerventi 2014-2021 Tasso Variabile Amortizing	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 5,7%. Parametro di indicizzazione rilevato il quarto 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.
IT0005144834	Etrion 2015-2029 Tasso Variabile	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 2,25%. 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
IT0005121972	Fnm 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dell'1,5%. 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.
XS1057822766	Intesa Sanpaolo 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread 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 spread dell'1,05%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1623794457	Intesa Sanpaolo 2017-2024 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 1,10%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1562036456	Marcolin 2017-2023 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread del 4,125%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1562036704	Marcolin 2017-2023 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread del 4,125%. 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
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 spread 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 spread del 2,1%. – 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 spread del 2,1%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0835346056	Mediobanca 2012-2017 Index Linked	Premio eventuale al rimborso pari alla <i>performance</i> registrata dall'indice EURO STOXX 50 tra il 21 novembre 2012 ed il 14 novembre 2017. – La cedola premio non potrà assumere valore negativo.
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.

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
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.
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.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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.
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.

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
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%.
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%.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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.
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.

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
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.
IT0005040024	Mediobanca 2014-2021 Opzioni digitali sull'indice EuroSTOXX50	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al 3% 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 (8 settembre 2016, 7 settembre 2017, 7 settembre 2018, 7 settembre 2019, 9 settembre 2020 e 8 settembre 2021) sia maggiore al valore dell'EuroSTOXX50 alla media aritmetica semplice dei valori di chiusura dell'1, 2, 3, 4 e 5 settembre 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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

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.
IT0005127151	Mediobanca 2015-2022 Opzioni digitali	Interessi annuali pari al 3% al verificarsi di un evento azionario. – L'evento si verifica qualora il valore di ciascun indice del paniere alle due date di riferimento finali (21 ottobre 2016 e 23 ottobre 2017) sia maggiore al 95% del valore di ciascun indice del 21 ottobre 2015 e per la altre date di riferimento finali (22 ottobre 2018, 21 ottobre 2019, 2020, 2021 e 2022) sia maggiore al 100% del valore di ciascun indice del 21 ottobre 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.
IT0005239253	Mediobanca 2017-2023 Passo Euro Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,00% con <i>cap</i> 4% e <i>floor</i> 1% 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
IT0005239261	Mediobanca 2017-2023 Passo Sterlina Tasso Variabile GBP	Interessi trimestrali pari al tasso GPB Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dell' 1,50% con cap 4,50% e floor 1,50% annui. 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%.
XS1615501837	Mediobanca 2017-2022 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,80%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
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%.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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%.
IT0005135691	Mercedes-Benz Financial Services Italia 2015-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,55%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005135741	Mercedes-Benz Financial Services Italia 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,81%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005187486	Mercedes-Benz Financial Services Italia 2016-2018 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,43%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005244196	Mercedes-Benz Financial Services Italia 2017-2019 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,3%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005260085	Mercedes-Benz Financial Services Italia 2017-2020 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,35%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0004975485	Milleuno Bingo 2013-2018 Tasso Variabile Amortizing	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread del 5,6%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0005041030	MPG Manifattura Plastica 2014-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread del 4%. 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
XS0986071370	Rhino Bondco 2013-2019 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 5,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS0986071453	Rhino Bondco 2013-2019 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> del 5,5%. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
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%.
IT0003953376	SCCI 2005-2018 ABS Serie 9 Indicizzato Callable	Interessi semestrali pari all'Euribor a 6 mesi maggiorato dello 0,15%.
IT0003953384	SCCI 2005-2019 ABS Serie 10 Indicizzato Callable	Interessi semestrali pari all'Euribor a 6 mesi maggiorato dello 0,16%.
XS1454976801	Schumann 2016-2022 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 6,625%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1454978096	Schumann 2016-2022 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 6,625%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0003731426	SCIC 2004-2023 A2 Callable	Interessi semestrali pari all'Euribor a 6 mesi maggiorato dello 0,13% su base annua.
IT0005220691	Sonnedit Italia 2016-2030 Tasso Variabile Callable	Interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 2,30%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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.
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.
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.
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.
NL0009288113	ABN AMRO Bank 2009-2019 Obbligazione Royal EONIA 165	Dalla seconda cedola interessi trimestrali indicizzati all'Euro Overnight Index Average (EONIA).

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
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.
NL0009289321	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal Sicurezza	In aggiunta alla cedola fissa, pari al 6,5% per il 2010 e allo 0,3% per gli anni dal 2011, verranno sommati interessi trimestrali pari al massimo tra 3,2% e il tasso Euribor a 3 mesi. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
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.
XS0638296920	Bank of America 2011-2018 Invest Bond Oro	Dalla quarta cedola interessi annuali pari al prodotto tra l'8% del valore nominale ed il rapporto tra il n. dei giorni del periodo di interessi – a partire dal 15-VI-2015 fino a scadenza – in cui il valore dell'oro sia maggiore o uguale a 1,3 USD e minore o uguale a 2 USD, ed il n. dei giorni del periodo di interessi.
XS1079726763	Bank of America 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	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.
XS1290851184	Bank of America 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,85%. 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
XS1458405112	Bank of America 2016-2019 Tasso Variabile	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.
XS1602557495	Bank of America 2017-2023 Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,78%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
US06051GGJ22	Bank of America 2017-2023 Tasso Variabile USD Callable	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 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.
IT0006708421	Barclays Bank 2009-2019 DJ EURO STOXX 50	Premio al rimborso pari al maggior valore tra zero e il 200% del rapporto tra il livello di chiusura dell'indice Dow Jones EURO STOXX 50 al 4-X-2019 e il livello minimo di chiusura fra tutti i valori di riferimento durante il periodo di osservazione.. Il premio non negativo non potrà superare il 100% del valore nominale.
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.

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
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.
IT0006714395	Barclays Bank 2010-2021 Inverse Floater Floored Notes	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al massimo tra 2% e la differenza tra 9% 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.
IT0006715400	Barclays Bank 2010-2019 Floating Rate Notes	Interessi mensili pari al massimo tra 3% e l'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.
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.
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.
IT0006716440	Barclays Bank 2010-2020 Inflation Floored Notes	Dalla seconda cedola interessi annuali pari al massimo tra 2,5% e la variazione annuale (purché non negativa) dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro, relativa al giugno precedente la data di godimento della cedola, maggiorata dello 0,25%.
IT0006716556	Barclays Bank 2010-2025 Super Floater Notes	Interessi annuali pari all'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360. A partire dalla quarta cedola il tasso viene maggiorato 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
IT0006717372	Barclays Bank 2010-2018 Floater Notes	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 secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
IT0006729781	Barclays Bank 2014-2024 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.
IT0006729799	Barclays Bank 2014-2024 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.
IT0006729948	Barclays Bank 2014-2024 Tasso Variabile	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al tasso Euribor a 6 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,22%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1594368539	BBVA 2017-2022 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,60%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1363560548	Bmw Finance 2016-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,65%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
DE000A1Z6M04	BMW US Capital 2015-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,38%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1167154654	BNP Paribas 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,4%. 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
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.
XS1584041252	BNP Paribas 2017-2022 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,85%. 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.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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.
XS1408406020	BNP Paribas Arbitrage Issuance 2016-2026 Misto Misto NZD	Dalla nona cedola interessi trimestrali pari al tasso NZD-BBR-FRA a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,25% con <i>cap</i> 6,5% 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.
XS1417876759	Citigroup 2016-2021 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,83%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
US172967LH22	Citigroup 2017-2022 Tasso Variabile USD Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,96%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1170317645	Commonwealth Bank Of Australia 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,40%. 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.

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
XS1389223758	Citigroup Global Markets Holdings 2017-2025 USD 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 0,60% con <i>floor</i> 0% e <i>cap</i> 4% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1079975808	Credit Suisse 2014-2017 Tasso Variabile	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.
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.
XS1121919333	Credit Suisse 2014-2019 Tasso Variabile	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.
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.
XS1319598188	Credit Suisse 2015-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,46%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la 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.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS1396700194	Credit Suisse 2016-2024 Tasso Misto USD	Dalla quarta cedola interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,25% 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.
XS1396632504	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>floor</i> pari all'1,25% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la 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.
XS1444047697	Credit Suisse 2016-2026 Tasso Misto AUD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso AUD-BBR-BBSW a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>floor</i> pari al 2% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1532610323	Credit Suisse 2017-2027 Tasso Misto USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>floor</i> pari all'0,25% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1552684687	Credit Suisse 2017-2027 Tasso Misto USD	Dalla sesta cedola interessi annuali pari al tasso USD-Libor-BBA a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 4% e <i>floor</i> all'1,75% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1567811341	Credit Suisse 2017-2027 Tasso Misto GBP	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso GBP-Libor-BBA a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,50% con <i>cap</i> 4% annuo. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
DE000A169GZ7	Daimler 2016-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,53%. 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
XS1078028864	Daimler 2014-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,50%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1089831249	Deutsche Bahn Finance 2014-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,30%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
DE000DL19SS0	Deutsche Bank 2016-2018 Tasso indicizzato Euribor 3 Mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,9%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
DE000DL19TQ2	Deutsche Bank 2017-2022 Tasso indicizzato Euribor 3 Mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,80%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1382791892	Deutsche Telekom International Finance 2016-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari all'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,35%. 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 spread dello 0,9%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1292513105	FCE Bank 2015-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,98%. 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 spread dello 0,41%. 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
US36962GW752	GE Capital 2006-2026 Tasso Variabile USD	Interessi trimestrali pari al tasso Libor sul dollaro a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,38%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1078030928	GE Capital European Funding 2014-2018 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,4%. 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 spread dello 0,225%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1169331367	GE Capital European Funding 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,38%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1609252645	General Motors Financial Company 2017-2021 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,68%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1561100600	Goldman Sachs Finance Corporation International 2017-2027 Fixed to Floating	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con cap 3,25% e floor 0,5% annui. 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 spread 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 spread dello 0,7%. - 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
XS1265912094	Goldman Sachs Group 2015-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,55%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1289966134	Goldman Sachs Group 2015-2018 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,65%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1458408306	Goldman Sachs Group 2016-2021 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.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
XS1457382296	Goldman Sachs International 2016-2026 Fixed to Floating USD	Dalla sesta cedola interessi annuali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 3,25% e <i>floor</i> 0% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1457442025	Goldman Sachs International 2017-2027 Fixed to Floating USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 4% e <i>floor</i> 1,75% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1505033453	Goldman Sachs International 2017-2025 Fixed to US Inflation Linked Floating USD	Dalla terza cedola interessi annuali pari alla variazione percentuale annua dell'indice "USA – Non-revised Consumer Price index – Urban". Parametro di indicizzazione rilevato il mese di novembre precedente la data del godimento della cedola.
XS1064100115	JP Morgan Chase & Co. 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,6%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
US46647PAD87	JP Morgan Chase & Co. 2017-2023 Tasso Variabile USD Callable	Interessi trimestrali pari al tasso Libor sul dollaro 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.
IT0006598830	KFW 2005-2025 Fixed Rate to CMS Capped	Dalla quarta cedola interessi annuali pari al quidruplo 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.
XS1109333986	Lloyds Bank 2014-2019 Tasso Variabile	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.

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
XS1304487710	Lloyds Bank 2015-2020 Tasso Variabile	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.
IT0006721366	Macquarie Structured Securities 2011-2017 Obbligazioni 6% X	Dalla terza cedola interessi semestrali pari al 12% per il 2014 e 2015 al 18% per il 2016 e 2017 al verificarsi di un evento azionario. L'evento azionario si verifica qualora il valore più basso registrato da uno degli indici del paniere alla data di riferimento sia maggiore o uguale ad Euro 21,15 per il primo indice, Euro 12,965 per il secondo indice ed Euro 12,73 per il terzo indice. Il paniere è composto dai seguenti indici: – Royal Dutch Shell Plc; – France Telecom SA; – Assicurazioni Generali. I valori di riferimento di ciascun indice sono rilevati il 10 ottobre 2014 ed il 9 ottobre 2015, 2016 e 2017. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle.
XS1237187718	McDonald's Corporation 2015-2019 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.
XS1284577043	Merck 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 0,23%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1603892065	Morgan Stanley 2017-2022 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,70%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1242968979	Nordea Bank 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	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.
XS1345314956	Rabobank Nederland 2016-2018 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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
FR0012330124	RCI Banque 2014-2017 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,57%. 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.
FR0013250685	RCI Banque 2017-2021 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,65%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1272154565	Royal Bank of Canada 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,43%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1615065320	Santander UK Group Holdings 2017-2023 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,78%. 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.
XS1292468987	Shell International Finance 2015-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,4%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1291152624	Skandinaviska Enskilda Banken 2015-2020 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,47%. 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
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.
XS1265960739	Société Générale 2016-2026 USD Tasso Variabile Callable	Interessi trimestrali pari al tasso USD Libor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 con <i>cap</i> 4% e <i>floor</i> 2% annui. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1369605123	Société Générale 2016-2018 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari all'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.
XS1555910485	Société Générale 2017-2027 Tasso Variabile USD	Interessi trimestrali pari al tasso USD CMS 10 anni moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1277337678	Swedbank 2015-2020 Tasso Variabile	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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
NL0009292564	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Inflazione con cap&floor	Dalla terza cedola interessi pari alla variazione annuale (purché non negativa) dell'HICP <i>ex-tobacco</i> nei Paesi dell'Area Euro, relativa al giugno precedente la data di godimento della cedola, con <i>floor</i> 3% e <i>cap</i> 5% annuali.
NL0009294024	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal Ripresa	Interessi trimestrali pari all'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> decrescente nel tempo, pari al 2,5%, 2,25%, 2%, 1,75%, 1,5%, 1,25%, 1%, 0,75%, 0,5% e 0,25% annuo. 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 <i>ex-tobacco</i> nei Paesi dell'Area Euro, relativa al dicembre precedente la data di godimento della cedola.
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.
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.
NL0009408970	The Royal Bank of Scotland 2010-2018 Obbligazione Royal Variabile Max 6%	Interessi trimestrali pari al massimo tra 6% e l'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dell'1,8%. 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.

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
NL0009537935	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Obbligazione Royal Inflazione Italiana	Dalla terza cedola interessi annuali pari al massimo tra 2,5% e la 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 giugno precedente la data di pagamento.
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.
NL0009560028	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Obbligazione Royal Steep 2017	A partire dalla terza cedola, interessi semestrali pari al massimo tra zero e quattro volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009670074	The Royal Bank of Scotland 2011-2021 Mobile	Dalla tredicesima cedola interessi trimestrali pari al massimo tra 4,25% ed il tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
NL0009677947	The Royal Bank of Scotland 2011-2021 Inflazione	Dalla terza cedola interessi annuali pari al massimo tra zero e la variazione annuale dell'HICP ex-tobacco nei Paesi dell'Area Euro, relativa al novembre precedente la data di godimento della cedola, maggiorata dell'1,25%.
NL0009597939	The Royal Bank of Scotland 2010-2017 Floored Floater	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.
GB00B6HZ2257	The Royal Bank of Scotland 2011-2021 Obiettivo 8%	Dalla quinta cedola interessi trimestrali pari all'8% qualora l'Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 sia maggiore o uguale all'1,5% e minore o uguale al 4,5%. Qualora l'evento non si verifichi le cedole sono nulle. Parametro di indicizzazione rilevato il terzo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
GB00B78SXC73	The Royal Bank of Scotland 2012-2018 Tasso Misto con Digital Cap	Dalla quinta cedola interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno <i>spread</i> dello 0,7% e con un <i>cap</i> del 2,5%; qualora il tasso raggiunga il <i>cap</i> il tasso sarà pari al 5%. 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
XS1171489476	Toyota Motor Credit Corp 2015-2018 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.
XS1288335448	Toyota Motor Credit Corp 2015-2017 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.
DE000UB5WF78	UBS 2011-2021 Index linked Bonds	Interessi annuali pari al 50% della <i>performance</i> dell'indice S&P BRIC 40 Daily Risk Control 10 con <i>floor</i> 3,5%. La <i>performance</i> viene calcolata come rapporto tra la variazione dell'indice ed il numero corrispondente all'anno di pagamento della cedola. - La data di rilevamento iniziale della variazione è l'8-IV-2011, quella finale di ciascun anno il 24 marzo.
DE000UB8DSR5	UBS 2011-2017 Equity Liked Autocallable	Premio al rimborso subordinato al verificarsi di un evento azionario e conseguente rimborso anticipato. L'evento azionario si verifica qualora nessuno degli indici del paniere alla data di rilevazione sia superiore al valore soglia. Il paniere è composto dai seguenti indici: - Enel; - Snam; - Terna. Il premio al rimborso è pari a 70 Euro ad obbligazione se l'evento si verifica nel 2013, 140 Euro nel 2014, 210 Euro nel 2015 e 280 Euro nel 2016. L'evento soglia è pari ad Euro 4,358 per l'azione Enel, 4,082 Euro per l'azione Snam e 3,156 Euro per l'azione Terna. Le date di rilevazione sono il 25 giugno 2013, il 24 giugno 2014 ed il 23 giugno 2015 e 2016.
DE000UU129F7	UBS 2012-2019 Equity Linked Autocallable CHF	In aggiunta alla prima cedola fissa, pagamento di una cedola variabile pari al 5%, o al 10%, o al 15%, o al 20%, o al 25% o al 30% del valore nominale e conseguente rimborso anticipato, subordinatamente al verificarsi di un evento azionario. L'evento azionario si verifica se, alla data di osservazione, i valori degli indici del paniere raggiungano un certo livello soglia (c.d. <i>strike</i>). Gli indici che compongono il paniere sono: - Nestlé; - Novartis; - Roche. Qualora non si verifichi l'evento azionario, la cedola sarà nulla. I valori finali di riferimento degli indici sono pari ai valori di chiusura del 4 giugno 2014 e 2015, 3 giugno 2016, 2 giugno 2017, 4 giugno 2018 e 2019; i livelli di <i>strike</i> devono essere pari a: 55,95 CHF per il titolo Nestlé, 51,05 per il titolo Novartis e 157,10 per il titolo Roche.

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
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 spread dello 0,95%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1057486471	Volkswagen International Finance 2014-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,6%. 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 spread dello 0,3%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1586555515	Volkswagen International Finance 2017-2019 Tasso Variabile	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,35%. 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 spread 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 spread dello 0,27%. 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
XS1061043797	Wells Fargo & Company 2014-2019 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,45%. Parametro di indicizzazione rilevato il secondo giorno lavorativo precedente la data del godimento della cedola.
XS1240966348	Wells Fargo & Company 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	Interessi trimestrali pari al tasso Euribor a 3 mesi moltiplicato per 365/360 più uno spread dello 0,42%. 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.
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.

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
XS0220777915	BEI 2005-2020 CMS Linked Callable	A partire dalla quarta cedola interessi pari a quattro volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni, rilevato cinque giorni lavorativi antecedenti la data di calcolo degli interessi. Nessuna cedola potrà essere inferiore allo 0,25% o superiore all'8%.
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%.
XS0225050680	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Callable Capped Floored	A partire dalla terza cedola interessi annuali pari a quattro 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% o superiori al tasso Swap Euro a 10 anni.
XS0220720303	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Callable Floored	A partire dalla terza cedola interessi annuali pari a quattro 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%.
XS0224943091	BEI 2005-2020 Fixed / CMS-Linked Callable Floored Capped	A partire dalla terza cedola interessi annuali pari a quattro 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% o superiori all'8%.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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.
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.
XS0223791517	BEI 2005-2035 Fixed / CMS-Linked Callable Floored Capped	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, rilevato due giorni lavorativi precedenti la data di godimento della cedola. Le cedole non potranno essere inferiori a 1,25% o superiori all'8%.
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. .
IT0006596313	BERS 2005-2020 Step-Up Twister Callable Capped Floored	A partire dalla terza cedola e per le successive cinque, interessi annuali pari a tre volte la differenza tra il tasso Swap Euro a 10 anni e quello a 2 anni. Per le successive quattro cedole interessi annuali pari a quattro volte la differenza tra i suddetti tassi. Per le cedole ancora successive interessi annuali pari a cinque volte la differenza tra i suddetti tassi. Le cedole non potranno essere inferiori all'1% o superiori all'8%.

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
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.
IT0006591942	BIRS 2005-2020 CMS-Linked Callable	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, rilevati cinque giorni lavorativi antecedenti la data di determinazione degli interessi. Le cedole non potranno essere inferiori all'1%.
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.
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.

MODALITÀ DI INDICIZZAZIONE DEGLI INTERESSI E DEL CAPITALE

METHODS OF INDEX-LINKING PRINCIPAL AMOUNT AND INTEREST

Codice ISIN	Titoli	Modalità di indicizzazione
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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
			DI STATO					
IT0000366655	BTP 1993-2023 9%	146,29	6,85	2,08	0,70	6,04	6,24	1,34
IT0001086567	BTP 1996-2026 7,25%	144,87	8,36	2,39	0,04	9,04	5,06	1,97
IT0001444378	BTP 2000-2031 6%	140,65	9,73	2,56	-1,03	13,10	4,31	2,52
IT0001174611	BTP 1997-2027 6,5%	139,69	8,71	2,47	-0,31	10,04	4,70	2,20
IT0003256820	BTP 2002-2033 5,75%	139,45	10,02	2,65	-1,45	15,07	4,16	2,66
IT0004286966	BTP 2007-2039 5%	131,48	10,83	2,67	-2,49	22,01	3,83	3,05
IT0001278511	BTP 1998-2029 5,25%	130,32	9,46	2,69	-0,86	12,04	4,06	2,41
IT0003535157	BTP 2003-2034 5%	130,26	10,39	2,89	-1,83	17,01	3,87	2,78
IT0004532559	BTP 2009-2040 5%	130,14	10,62	2,40	-3,04	23,02	3,87	3,18
IT0004923998	BTP 2013-2044 4,75%	126,83	10,91	2,03	-4,41	27,02	3,78	3,28
IT0004889033	BTP 2013-2028 4,75%	124,03	8,93	2,52	-0,92	11,02	3,86	2,31
IT0004513641	BTP 2009-2025 5%	123,53	7,95	2,17	0,10	7,08	4,08	1,72
IT0004848831	BTP 2012-2022 5,5%	123,01	6,89	2,32	1,02	5,04	4,52	1,06
IT0004801541	BTP 2012-2022 5,5%	122,64	6,79	2,27	0,95	4,08	4,53	0,58
IT0004644735	BTP 2010-2026 4,5%	120,69	8,13	2,26	-0,20	9,02	3,76	2,03
IT0004356843	BTP 2008-2023 4,75%	120,53	7,31	2,35	0,75	6,01	3,97	1,24
IT0004953417	BTP 2013-2024 4,5%	119,19	7,72	2,10	0,58	7,01	3,81	1,63
IT0004759673	BTP 2011-2022 5%	119,08	6,47	2,12	1,05	4,08	4,24	0,83
IT0004898034	BTP 2013-2023 4,5%	118,50	7,30	2,24	0,79	5,10	3,83	1,21
IT0004695075	BTP 2011-2021 4,75%	117,02	6,12	2,14	1,16	3,08	4,09	0,10
IT0003934657	BTP 2005-2037 4%	116,78	10,46	3,29	-1,68	19,07	3,45	2,89
IT0005001547	BTP 2014-2024 3,75%	114,38	—	2,09	0,42	7,02	3,30	1,62
IT0004009673	BTP 2006-2021 3,75%	112,74	6,03	2,18	1,12	4,01	3,35	0,59
IT0004966401	BTP 2013-2021 3,75%	112,39	5,98	2,12	1,11	3,10	3,36	0,49

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
			DI STATO					
IT0004634132	BTP 2010-2021 3,75%	112,25	5,85	2,09	1,19	3,08	3,36	0,39
IT0004594930	BTP 2010-2020 4%	111,79	5,21	1,87	0,97	3,02	3,60	0,26
IT0005024234	BTP 2014-2030 3,5%	111,22	—	2,43	-1,65	12,08	3,17	2,48
IT0003644769	BTP 2004-2020 4,5%	111,20	4,73	1,58	0,71	2,07	4,08	0,16
IT0004536949	BTP 2009-2020 4,25%	110,80	4,80	1,57	0,71	2,08	3,87	0,19
IT0004489610	BTP 2009-2019 4,25%	109,10	4,22	1,41	0,66	2,02	3,93	0,05
IT0004423957	BTP 2008-2019 4,5%	107,71	3,72	1,21	0,51	1,08	4,22	-0,11
IT0003493258	BTP 2003-2019 4,25%	106,93	3,66	1,21	0,44	1,07	4,01	-0,11
IT0005028003	BTP 2014-2021 2,15%	106,23	—	2,29	1,17	4,05	2,03	0,73
IT0005045270	BTP 2014-2024 2,5%	105,69	—	2,06	0,20	7,05	2,37	1,69
IT0004957574	BTP 2013-2018 3,5%	105,28	3,56	1,18	0,42	1,05	3,35	-0,21
IT0004361041	BTP 2008-2018 4,5%	105,24	3,09	1,04	0,35	1,01	4,32	-0,31
IT0004992308	BTP 2014-2019 2,5%	104,70	3,55	1,32	0,58	1,10	2,40	-0,06
IT0004907843	BTP 2013-2018 3,5%	103,52	2,97	1,00	0,30	0,11	3,40	-0,32
IT0005030504	BTP 2014-2019 1,5%	103,14	—	1,49	0,67	2,01	1,45	-0,01
IT0004273493	BTP 2007-2018 4,5%	102,81	2,59	0,80	0,14	0,07	4,42	-0,28
IT0005069395	BTP 2014-2019 1,05%	102,30	—	1,63	0,79	2,05	1,02	0,10
IT0005135840	BTP 2015-2022 1,45%	102,25	—	—	0,91	5,02	1,42	1,01
IT0005086886	BTP 2015-2022 1,35%	102,22	—	—	1,03	4,09	1,32	0,88
IT0005107708	BTP 2015-2020 0,7%	101,41	—	—	0,93	2,10	0,69	0,20
IT0005142143	BTP 2015-2020 0,65%	101,17	—	—	1,17	3,04	0,64	0,30
IT0005127086	BTP 2015-2025 2%	100,99	—	—	-0,19	8,05	1,99	1,88
IT0005139099	BTP 2015-2018 0,3%	100,79	—	—	0,40	1,03	0,29	-0,31
IT0005058463	BTP 2014-2018 0,75%	100,59	—	0,76	0,12	0,06	0,74	-0,34
IT0005106049	BTP 2015-2018 0,25%	100,53	—	—	0,30	0,10	0,24	-0,35

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
			IT0005083057	BTP 2014-2046 3,25%	100,01		—	1,61
IT0005090318	BTP 2015-2025 1,5%	97,97	—	—	-0,26	7,11	1,53	1,78
IT0005094088	BTP 2015-2032 1,65%	89,50	—	—	-2,79	14,08	1,85	2,52
IT0004922909	CCTeu 2013-2018	102,43	2,13	1,00	0,12	1,04	1,55	-0,23
IT0005009839	CCTeu 2013-2019	102,38	—	1,12	0,12	2,04	0,95	-0,03
IT0005056541	CCTeu 2014-2020	101,67	—	1,32	0,22	3,05	0,52	0,05
IT0004716319	CCTeu 2011-2018	100,83	1,83	0,75	0,02	0,09	0,76	-0,28
IT0005137614	CCTeu 2015-2022	100,58	—	—	-0,06	5,05	0,43	0,33
IT0005104473	CCTeu 2014-2022	100,05	—	—	-0,07	4,11	0,28	0,27
XS0098449456	Republic of Italy 1999-2029 CMS 30Y con Floor 4,25%	117,04	7,70	4,31	-0,58	12,00	3,63	2,58
XS0100688190	Republic of Italy 1999-2019 Euro CMS	100,37	1,83	0,87	0,20	2,02	0,00	0,42
DE0001141711	BOBL 2015-2020 0%	101,47	—	0,09	0,76	2,09	0,00	-0,52
ES00000124V5	Bonos 2014-2019 2,75%	105,47	—	1,19	0,90	1,09	2,60	-0,22
ES00000126C0	Bonos 2014-2020 1,4%	104,23	—	2,05	1,91	2,07	1,34	-0,16
ES00000127H7	Bonos 2015-2020 1,15%	103,93	—	—	2,16	3,01	1,10	-0,12
ES00000127D6	Bonos 2015-2018 0,25%	100,51	—	—	0,35	0,09	0,24	-0,36
DE0001135366	Bund 2008-2040 4,75%	175,03	9,74	2,74	2,92	23,00	2,71	1,06
DE0001135176	Bund 2000-2031 5,5%	161,17	7,76	2,03	8,08	13,06	3,41	0,73
DE0001135275	Bund 2005-2037 4%	153,18	9,72	2,57	7,99	19,06	2,61	0,99
DE0001135432	Bund 2010-2042 3,25%	145,30	10,86	2,41	3,48	25,00	2,23	1,15
DE0001135085	Bund 1998-2028 4,75%	144,51	6,85	1,66	2,06	11,00	3,28	0,57
DE0001134922	Bund 1994-2024 6,25%	140,71	4,58	1,22	7,97	6,06	4,44	0,00
DE0001102341	Bund 2014-2046 2,5%	130,92	—	2,35	4,51	29,01	1,90	1,23
DE0001135481	Bund 2012-2044 2,5%	129,61	11,39	1,91	3,21	27,00	1,92	1,21

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
			DE0001102325	Bund 2013-2023 2%	112,54		5,06	1,35
DE0001135457	Bund 2011-2021 2,25%	110,87	3,25	0,99	0,98	4,02	2,02	-0,33
DE0001135408	Bund 2010-2020 3%	110,59	2,63	0,64	0,54	3,00	2,71	-0,48
DE0001102358	Bund 2014-2024 1,5%	109,88	—	1,66	1,61	6,10	1,36	0,06
DE0001135473	Bund 2012-2022 1,75%	109,84	4,24	0,99	1,16	5,00	1,59	-0,20
DE0001135390	Bund 2009-2020 3,25%	109,63	2,31	0,47	4,71	2,06	2,96	-0,55
DE0001102317	Bund 2013-2023 1,5%	109,25	4,99	1,30	1,53	5,10	1,37	-0,07
DE0001102309	Bund 2013-2023 1,5%	109,04	4,80	1,34	1,33	5,07	1,37	-0,10
DE0001135499	Bund 2012-2022 1,5%	108,74	4,41	1,10	1,09	5,02	1,37	-0,18
DE0001135416	Bund 2010-2020 2,25%	108,71	2,71	0,74	0,55	3,02	2,06	-0,46
DE0001135382	Bund 2009-2019 3,5%	108,22	1,70	0,36	0,16	2,00	3,23	-0,55
DE0001135374	Bund 2008-2019 3,75%	106,64	1,15	0,21	4,94	1,06	3,51	-0,61
DE0001102366	Bund 2014-2024 1%	106,44	—	1,58	2,06	7,01	0,93	0,09
DE0001102382	Bund 2015-2025 1%	106,20	—	—	2,69	8,01	0,94	0,23
DE0001102374	Bund 2015-2025 0,5%	102,55	—	-0,12	2,22	7,07	0,48	0,16
DE0001135341	Bund 2007-2018 4%	102,35	0,76	0,00	5,05	0,06	3,90	-0,57
DE0001141653	Bund 2013-2018 0,5%	100,76	0,94	0,04	-0,20	0,07	0,49	-0,66
GR0114028534	GGB 2014-2019 4,75%	101,93	—	15,47	12,71	1,09	4,65	3,61
GR0128010676	GGB 2012-2023 Step Up 2%	93,65	13,01	18,30	20,68	5,07	3,20	4,61
GR0128011682	GGB 2012-2024 Step Up 2%	91,69	13,28	17,95	20,49	6,07	3,27	4,93
GR0128013704	GGB 2012-2026 Step Up 2%	90,49	15,39	22,58	24,56	8,07	3,31	4,98
GR0128012698	GGB 2012-2025 Step Up 2%	90,41	14,10	19,92	22,34	7,07	3,31	5,07
GR0128014710	GGB 2012-2027 Step Up 2%	88,29	15,41	22,24	24,66	9,07	3,39	5,23
GR0133006198	GGB 2012-2028 Step Up 2%	85,44	15,21	21,91	23,79	10,07	3,51	5,54
GR0133007204	GGB 2012-2029 Step Up 2%	83,14	14,85	20,72	23,13	11,07	3,60	5,76

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
GR0133008210	GGB 2012-2030 Step Up 2%	81,27	14,68	21,34	23,94	12,07	3,69	5,90
GR0133009226	GGB 2012-2031 Step Up 2%	80,30	15,15	21,74	24,73	13,07	3,73	5,93
GR0133010232	GGB 2012-2032 Step Up 2%	78,38	14,75	20,01	24,55	14,07	3,82	6,08
GR0138005716	GGB 2012-2033 Step Up 2%	77,01	14,81	19,61	24,44	15,07	3,89	6,15
GR0138006722	GGB 2012-2034 Step Up 2%	76,01	14,80	19,75	24,06	16,07	3,94	6,19
GR0138007738	GGB 2012-2035 Step Up 2%	74,81	14,48	19,21	22,82	17,07	4,01	6,25
GR0138008744	GGB 2012-2036 Step Up 2%	74,03	14,44	19,36	24,59	18,07	4,05	6,27
GR0138009759	GGB 2012-2037 Step Up 2%	73,56	14,50	18,97	23,67	19,08	4,07	6,25
GR0138014809	GGB 2012-2042 Step Up 2%	73,41	14,56	18,15	23,85	24,08	4,08	6,03
GR0138010765	GGB 2012-2038 Step Up 2%	73,37	14,34	19,32	24,64	20,08	4,08	6,21
GR0138012787	GGB 2012-2040 Step Up 2%	73,19	14,61	18,54	24,31	22,08	4,09	6,13
GR0138011771	GGB 2012-2039 Step Up 2%	73,02	14,48	18,44	23,84	21,08	4,10	6,20
GR0138013793	GGB 2012-2041 Step Up 2%	72,96	14,36	17,56	24,25	23,08	4,11	6,11
FR0000187635	OAT 2000-2032 5,75%	163,50	8,67	2,63	2,71	15,03	3,51	1,19
FR0000571218	OAT 1997-2029 5,5%	150,67	7,34	3,10	2,25	11,09	3,65	0,95
FR0010371401	OAT 2005-2038 4%	145,67	10,43	3,57	4,85	21,04	2,74	1,48
FR0011461037	OAT 2012-2045 3,25%	132,93	12,28	3,37	5,43	27,11	2,44	1,75
FR0010916924	OAT 2010-2026 3,5%	124,89	6,99	2,46	3,16	8,09	2,80	0,59
FR0011883966	OAT 2013-2030 2,5%	116,95	—	2,79	3,71	12,10	2,13	1,08
FR0010192997	OAT 2005-2021 3,75%	115,37	3,60	1,18	1,01	3,09	3,25	-0,25
FR0011337880	OAT 2011-2022 2,25%	111,93	5,28	1,84	1,65	5,03	2,01	0,01
FR0011486067	OAT 2012-2023 1,75%	109,74	5,84	1,71	1,96	5,10	1,59	0,09
FR0010949651	OAT 2009-2020 2,5%	109,45	3,44	1,02	0,97	3,03	2,28	-0,35
FR0012993103	OAT 2015-2031 1,5%	104,14	—	—	4,34	13,10	1,44	1,17
FR0012938116	OAT 2014-2025 1%	103,64	—	—	2,96	8,04	0,96	0,56

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
FR0011394345	OAT 2012-2018 1%	101,43	1,44	0,20	-0,03	0,10	0,98	-0,58
FR0012634558	OAT 2015-2018 0%	100,40	—	—	0,04	0,07	0,00	-0,61
FR0012517027	OAT 2014-2025 0,5%	100,26	—	—	3,23	7,10	0,49	0,47
ES0000011868	Obligaciones del Estado 1999-2029 6%	144,64	10,99	4,26	4,32	11,07	4,14	1,72
ES00000120N0	Obligaciones del Estado 2007-2040 4,9%	140,35	—	3,76	5,17	23,01	3,49	2,56
ES00000124C5	Obligaciones del Estado 2013-2028 5,15%	135,18	11,13	3,87	4,44	11,04	3,80	1,71
ES0000012932	Obligaciones del Estado 2005-2037 4,2%	127,75	—	3,08	5,16	19,07	3,28	2,40
ES00000122E5	Obligaciones del Estado 2010-2025 4,65%	126,78	9,70	3,09	3,90	8,01	3,66	1,16
ES00000123X3	Obligaciones del Estado 2013-2023 4,4%	122,90	8,84	2,76	3,71	6,04	3,58	0,69
ES00000122D7	Obligaciones del Estado 2010-2020 4%	111,73	5,31	2,01	1,92	2,10	3,58	-0,13
ES00000127G9	Obligaciones del Estado 2015-2025 2,15%	107,04	—	—	4,36	8,04	2,00	1,25
ES00000126Z1	Obligaciones del Estado 2015-2025 1,6%	103,66	—	2,19	4,01	7,10	1,54	1,11
ES00000127A2	Obligaciones del Estado 2015-2030 1,95%	100,42	—	—	4,74	13,01	1,94	1,91
PTOTEQOE0015	Obrigacoes do Tesouro 2013-2024 5,65%	121,93	—	3,51	3,80	6,07	4,63	2,07
PTOTEAOE0021	Obrigacoes do Tesouro 2008-2023 4,95%	118,37	—	3,46	3,18	6,03	4,18	1,84
PTOTECOE0029	Obrigacoes do Tesouro 2010-2020 4,8%	113,01	—	2,84	2,40	2,11	4,24	0,37
PTOTEMOE0027	Obrigacoes do Tesouro 2009-2019 4,75%	109,03	—	2,25	1,41	1,11	4,35	0,13

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
PTOTE5OE0007	Obrigacoes do Tesouro 2006-2037 4,1%	104,84	—	0,76	1,55	19,09	3,91	3,75
PTOTESOE0013	Obrigacoes do Tesouro 2015-2022 2,2%	104,47	—	—	3,74	5,03	2,10	1,32
PTOTENOE0018	Obrigacoes do Tesouro 2008-2018 4,45%	104,33	—	1,45	0,40	0,11	4,26	-0,07
PTOTEROE0014	Obrigacoes do Tesouro 2014-2030 3,875%	103,97	—	2,76	0,92	12,07	3,72	3,47
PTOTEBOE0020	Obrigacoes do Tesouro 2015-2045 4,1%	102,58	—	-0,79	1,70	27,07	3,99	3,94
PTOTEKOE0011	Obrigacoes do Tesouro 2015-2025 2,87%	102,26	—	0,08	2,43	8,03	2,80	2,56
NL0010071189	Regno dei Paesi Bassi 2012-2033 2,5%	122,74	—	1,98	4,74	15,06	2,03	0,92
BE0000321308	Regno del Belgio 2011-2021 4,25%	119,07	—	1,28	0,75	4,02	3,56	-0,22
BE0000335449	Regno del Belgio 2015-2031 1%	98,05	—	—	5,13	13,11	1,01	1,15
NL0011220108	Regno d'Olanda 2015-2025 0,25%	99,22	—	—	2,76	8,00	0,25	0,35
IT0006527532	Repubblica Ellenica 1999-2019 5%	101,84	7,97	8,77	7,62	1,08	4,90	3,84
FI4000148630	Repubblica Finlandese 2015-2031 0,75%	97,34	—	—	4,45	13,09	0,77	0,96
XS1288467605	Repubblica Polacca 2015-2025 1,5%	104,54	—	—	2,89	8,02	1,43	0,92
XS1209947271	Repubblica Polacca 2015-2027 0,875%	97,65	—	—	3,53	9,10	0,89	1,13
AT0000A10683	Republic of Austria 2013-2034 2,4%	119,33	9,72	1,84	5,12	16,10	2,01	1,14
XS0229808315	Republic of Austria 2005-2025 CMS Spread-Linked	106,43	4,27	3,03	2,69	8,03	1,18	0,47

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
XS0216258763	Republic of Austria 2005-2020 CMS Spread Floater Notes	101,94	1,68	0,64	0,76	2,09	0,44	-0,24
XS0231558858	Republic of Austria 2005-2035 Fixed to CMS-Linked	101,31	1,51	0,60	-0,24	18,03	0,17	0,10
IT0006592080	Republic of Austria 2005-2022 CMS-Linked Flippable	100,45	1,23	0,15	-0,21	4,11	0,00	-0,09
IE00BJ38CR43	Republic of Ireland 2014-2030 2,4%	113,51	—	3,79	4,55	12,10	2,11	1,26
IE0034074488	Republic of Ireland 2004-2020 4,5%	113,43	—	—	0,83	2,09	3,96	-0,27
IE00B28HXX02	Republic of Ireland 2007-2018 4,5%	106,29	—	0,60	-0,01	1,03	4,23	-0,32
IE00BV8C9186	Republic of Ireland 2015-2045 2%	101,61	—	—	5,27	27,07	1,96	1,92
DI ENTI E SOCIETÀ								
IT0005075533	Alerion Clean Power 2015-2022 6% Callable	106,44	—	—	6,75	4,07	5,63	4,42
XS0452314536	Assicurazioni Generali 2009-2024 5,125%	128,80	9,06	3,80	4,40	7,02	3,97	0,97
IT0004869985	Atlantia 2012-2018 3,625%	105,16	3,32	1,23	0,94	1,05	3,44	-0,02
IT0005108490	Autostrade per l'Italia 2015-2023 1,625%	104,07	—	—	3,98	5,11	1,56	0,92
IT0001330411	Banca Carige 1999-2019 Indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni con Floor 4%	101,88	4,17	3,47	4,77	1,10	3,92	2,95
IT0000966017	Banca Commerciale Italiana 1997-2027 Zero Coupon	79,11	10,17	4,64	5,05	9,06	0,00	2,49
IT0001200390	Banca Commerciale Italiana 1998-2028 Zero Coupon	75,42	9,78	3,58	3,70	10,07	0,00	2,69

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
IT0004957020	Banca IMI 2013-2019 Tasso Fisso Sprint BancoPosta	107,75	4,31	3,03	2,60	2,04	2,92	0,41
IT0004936545	Banca IMI 2013-2019 4,5% Sprint BancoPosta	107,25	4,29	2,89	2,73	2,02	2,98	0,43
IT0004796451	Banca IMI 2012-2018 Collezione Step Up	102,90	3,01	0,85	0,66	0,08	4,71	0,57
XS1051696398	Banca Monte dei Paschi di Siena 2014-2019 3,625%	96,18	—	1,47	1,33	1,09	3,76	5,97
XS0540544912	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5,6%	46,80	-11,27	-20,37	-31,00	3,02	11,96	36,20
XS0503326083	Banca Monte dei Paschi di Siena 2010-2020 5%	46,66	-11,23	-20,31	-30,94	2,09	10,71	39,64
XS0985326502	Banca Popolare di Vicenza 2013-2018 5%	104,69	5,37	4,10	12,22	1,03	4,77	1,38
XS1205644047	Banca Popolare di Vicenza 2,75%	104,03	—	—	17,98	2,08	2,64	1,23
XS0555834984	Banco BPM 2010-2020 6%	106,70	6,75	5,10	8,48	3,04	5,62	3,82
XS0632503412	Banco BPM 2011-2021 6,375%	108,40	7,26	4,43	8,30	3,11	5,88	4,01
XS0597182665	Banco BPM 2011-2021 7,125%	110,00	7,79	4,90	7,46	3,08	6,47	4,12
XS1070681397	Banco BPM 2014-2018 2,375%	101,07	—	2,48	2,67	0,06	2,34	0,47
XS1044894944	Banco BPM 2014-2019 3,5%	103,89	—	3,21	4,17	1,08	3,36	1,18
XS1024830819	Banco BPM 2014-2019 4,25%	104,96	—	3,12	2,48	1,07	4,04	1,07
XS1293577208	Banco BPM 2015-2018 2,625%	102,24	—	—	3,68	1,02	2,56	0,78
XS1266866927	Banco BPM 2015-2020 2,75%	103,23	—	—	4,18	3,00	2,66	1,66
IT0005120313	Banco BPM 2015-2022 Tier2 Tasso Variabile Callable	104,87	—	—	7,01	5,01	3,91	3,04
IT0001304341	BIM-IMI 1999-2024 Fixed & Zero con Premio Fisso al Rimborso	188,34	8,23	4,44	4,38	6,07	0,00	2,38
IT0001271003	BIM-IMI 1998-2018 Step-Down con Premio Fisso al Rimborso	153,85	4,20	2,75	2,50	1,04	0,00	0,55

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
XS1300465926	Campari 2015-2020 2,75%	107,29	—	—	5,39	3,03	2,56	0,48
IT0005105488	CDP 2015-2025 1,5%	97,69	—	—	1,57	7,09	1,53	1,82
IT0001312708	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Eurostability Bond	123,57	5,21	3,33	3,87	1,08	0,00	0,67
IT0001300992	Centrobanca 1999-2019 Step-Down Indicizzato al Tasso Swap Euro a 10 Anni	99,90	2,98	1,71	1,80	1,06	0,46	0,52
IT0001197083	Centrobanca 1998-2018 Zero Coupon	99,84	3,56	2,37	1,81	0,07	0,00	0,27
XS1088811432	CMC di Ravenna 2014-2021 7,5%	102,80	—	14,06	19,85	4,01	7,42	6,81
IT0004870926	Credem 2012-2018 4,7% Amortizing Callable	103,17	—	3,75	3,65	0,11	4,55	1,45
IT0001317707	Crediop 1999-2019 Step-Down Lifestyle Accrued Interest	165,14	6,61	4,39	6,72	1,08	0,00	2,19
IT0001308607	Crediop 1999-2024 Step-Down	161,15	11,16	7,44	10,08	6,07	0,00	3,29
IT0005030306	E.S.T.R.A. 2014-2019 5%	102,00	—	5,84	5,12	2,00	4,90	3,96
XS0306646042	Enel 2007-2027 5,625%	137,65	—	3,77	3,21	9,11	4,08	1,53
XS0170343247	Enel 2003-2018 4,75%	104,50	2,69	1,08	0,61	0,11	4,54	0,02
IT0004794142	Enel 2012-2018 4,875%	103,19	2,71	1,12	0,75	0,07	4,72	-0,11
IT0004794159	Enel 2012-2018 Tasso Variabile	101,96	1,83	0,70	0,48	0,07	2,85	-0,17
XS1292988984	Eni 2015-2024 1,75%	104,87	—	—	4,15	6,06	1,66	0,98
XS1180451657	Eni 2015-2026 1,5%	102,20	—	—	4,03	8,07	1,46	1,23
IT0005104713	Ferrarini 2015-2020 6,375%	101,60	—	—	4,91	2,09	6,37	5,82
IT0005074577	Intek Group 2015-2020 5% Callable	103,95	—	6,22	6,17	2,07	4,80	3,40
IT0001304010	Interbanca 1999-2021 Coupon Reset	135,69	5,74	4,31	6,13	3,07	0,00	2,80
XS0971213201	Intesa Sanpaolo 2013-2023 6,625%	122,80	9,06	5,16	6,28	6,02	5,39	2,60

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
XS0986194883	Intesa Sanpaolo 2013-2023 4%	117,20	7,65	2,50	4,09	6,04	3,41	1,17
XS0526326334	Intesa Sanpaolo 2010-2020 5,15%	112,02	6,51	5,11	5,33	3,00	4,59	1,11
XS0500187843	Intesa Sanpaolo 2010-2020 4,125%	110,82	5,24	2,33	2,33	2,09	3,72	0,23
XS0452166324	Intesa Sanpaolo 2010-2019 5%	109,05	5,58	4,38	5,22	2,02	4,58	0,89
XS1109765005	Intesa Sanpaolo 2014-2026 3,928%	106,30	—	4,59	5,89	9,02	3,69	3,13
XS0555977312	Intesa Sanpaolo 2010-2018 4%	105,43	3,47	1,47	1,15	1,04	3,79	-0,01
XS1168003900	Intesa Sanpaolo 2015-2020 1,125%	102,25	—	1,81	2,39	2,06	1,10	0,24
XS1197351577	Intesa Sanpaolo 2015-2022 1,125%	101,41	—	—	3,38	4,08	1,10	0,82
XS1246144650	Intesa Sanpaolo 2015-2020 Tasso Variabile	101,29	—	—	1,55	2,11	1,02	0,60
XS1222597905	Intesa Sanpaolo 2015-2025 2,855%	100,55	—	—	4,38	7,09	2,83	2,77
XS1314238459	Iren 2015-2022 2,75%	109,36	—	—	5,26	5,04	2,51	0,94
IT0001086658	Istituto Bancario San Paolo di Torino 1997-2022 Zero Coupon	95,41	5,87	4,60	3,41	4,07	0,00	1,03
XS0215093534	Leonardo 2005-2025 4,875%	121,89	9,23	8,01	9,99	7,08	3,99	1,81
XS0458887030	Leonardo 2009-2022 5,25%	119,00	9,21	6,91	8,28	4,06	4,41	0,97
XS0999654873	Leonardo 2013-2021 4,5%	113,14	7,96	5,94	6,83	3,06	3,97	0,74
XS0182242247	Leonardo 2003-2018 5,75%	107,74	4,51	2,33	2,52	1,05	5,33	0,39
XS1083010311	L'Isolante K-Flex 2014-2020 6%	102,95	—	7,11	8,24	3,00	5,82	4,91
XS0808635352	Manutencoop Facility Management 2013-2020 8,5%	102,21	8,19	17,43	25,40	3,01	8,57	7,90
IT0004917842	Mediobanca 2013-2023 5,75%	116,43	7,69	5,69	6,76	5,09	4,93	2,65

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
IT0004645542	Mediobanca 2010-2020 Secondo Atto 5% Subordinato Lower Tier 2	111,54	6,38	5,04	6,01	3,04	4,48	1,47
IT0004608797	Mediobanca 2010-2020 Primo Atto 4,5%	111,53	5,61	3,08	2,99	2,10	4,03	0,45
IT0004720436	Mediobanca 2011-2021 T.V. con Tasso Minimo e Tasso Massimo Sub. Lower Tier2	110,56	6,19	5,58	7,36	3,11	4,22	1,84
IT0004952336	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile Cap&Floor	109,10	5,60	4,51	5,56	6,02	2,80	1,51
IT0004935976	Mediobanca 2013-2023 Tasso Variabile con Cap&Floor	108,77	5,28	4,58	5,44	6,02	2,84	1,58
IT0004981871	Mediobanca 2014-2022 3,2%	108,62	—	4,13	4,86	4,07	2,94	1,28
XS0993892735	Mediobanca 2014-2022 3,2%	108,40	6,00	3,92	4,70	4,06	2,95	1,29
IT0004931082	Mediobanca 2013-2020 Tasso Variabile Cap&Floor	108,32	5,44	4,34	5,10	6,00	2,82	1,60
IT0005127508	Mediobanca 2015-2025 Valore	106,51	—	—	5,35	8,02	2,87	2,18
IT0005118796	Mediobanca 2015-2025 2,75% Callable	104,18	—	—	3,03	7,11	2,63	2,17
IT0004965577	Mediobanca 2013-2018 3,2%	103,99	3,95	2,29	2,15	1,05	3,07	0,39
IT0001287249	Mediocredito Centrale 1998-2018 Step-Down	147,86	4,87	3,78	3,82	1,05	0,00	2,83
IT0001306171	Mediocredito Centrale 1999-2019 Step-Down Zero Coupon	147,70	5,12	3,72	3,85	1,07	0,00	0,94
IT0001203253	Mediocredito Centrale 1998-2028 Zero Coupon	74,35	9,37	3,58	4,46	10,07	0,00	2,83
IT0001292850	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	100,56	3,30	1,83	1,96	1,06	0,49	0,14
IT0001336368	Mediocredito Lombardo 1999-2019 Step-Down indicizzato al Tasso Swap Euro 10 Anni	99,79	3,03	1,65	2,01	1,11	0,55	0,65

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
IT0001205589	Mediocredito Lombardo 1998-2028 Zero Coupon	75,38	9,55	4,21	4,12	10,07	0,00	2,69
IT0004936289	Mittel 2013-2019 6% Callable	104,30	5,32	4,69	4,57	2,00	5,83	3,82
XS1074596344	Officine Maccaferri 2014-2021 5,75%	100,75	—	10,16	13,43	3,11	5,78	5,61
XS1214547777	Prismian 2015-2022 2,5%	105,50	—	—	7,04	4,09	2,36	1,30
XS0956262892	Salini Impregilo 2013-2018 6,125%	107,00	—	5,68	5,62	1,01	5,72	-0,30
IT0001302659	Sanpaolo IMI 1999-2019 Indicizzato Swap Euro 10 Anni Floor 3,25%	104,65	3,77	2,89	2,85	1,06	3,10	0,28
XS1019326641	Snam 2014-2024 3,25%	115,01	6,77	3,02	5,14	6,06	2,82	0,89
XS0184373925	Telecom Italia 2004-2019 5,375%	108,33	5,30	3,68	2,56	1,06	4,96	0,10
XS0214965963	Telecom Italia 2005-2055 5,25%	108,60	12,38	7,98	10,23	37,08	4,83	4,75
XS0486101024	Telecom Italia 2010-2022 5,25%	120,15	9,53	6,87	8,14	4,07	4,36	0,79
XS0868458653	Telecom Italia 2012-2020 4%	109,35	6,56	4,63	3,92	2,06	3,65	0,33
XS0974375130	Telecom Italia 2013-2020 4,875%	114,48	7,65	5,71	3,99	3,02	4,25	0,37
XS1020952435	Telecom Italia 2014-2021 4,5%	114,40	4,74	5,98	5,98	3,06	3,93	0,43
XS1169832810	Telecom Italia 2015-2023 3,25%	110,45	—	4,54	8,73	5,06	2,94	1,28
IT0005012247	Tesmec 2014-2021 6%	101,15	—	6,63	6,07	3,09	5,93	5,64
IT0005009524	TIP 2014-2020 4,75%	107,91	—	5,15	4,73	2,09	4,40	1,81
IT0005038382	Trevi Finanziaria Industriale 2014-2019 5,25%	95,00	—	2,90	4,26	2,00	5,52	8,34
IT0004842370	UBI Banca 2012-2019 6% Amortizing	105,31	4,66	3,88	5,09	1,03	5,77	1,74
IT0004723489	UBI Banca 2011-2018 5,4% Amortizing	103,77	4,44	3,75	4,10	1,00	5,27	1,58

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
IT0004718489	UBI Banca 2011-2018 5,5% Amortizing	103,73	5,24	4,88	6,03	0,11	5,37	1,58
XS1041042828	UGF 2014-2021 4,375%	111,29	—	4,77	6,87	3,08	3,93	1,22
XS1206977495	UGF 2015-2025 3%	99,77	—	—	6,89	7,08	3,00	3,03
XS0367777884	UniCredit 2008-2018 6,7%	105,51	4,19	3,13	3,86	0,11	6,34	0,74
XS0618847775	UniCredit 2011-2021 6,125%	117,20	8,34	7,00	7,20	3,09	5,22	1,44
IT0004825029	UniCredit 2012-2018 5,65%	106,40	4,34	2,26	1,75	1,01	5,31	0,08
IT0004808421	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 5%	104,39	3,95	2,19	1,44	0,10	4,78	0,07
IT0004787476	UniCredit 2012-2018 BancoPosta 6,1%	104,21	3,74	2,07	1,31	0,08	5,85	0,16
XS0849517650	UniCredit 2012-2022 6,95%	120,86	8,78	6,69	7,87	5,04	5,75	2,70
IT0005022055	Unicredit 2014-2020 2,1% One-Step BancoPosta	104,20	—	3,12	3,50	3,01	2,01	0,72
XS1014627571	UniCredit 2014-2021 3,25%	109,65	2,31	2,90	3,09	3,06	2,96	0,49
XS1169707087	UniCredit 2015-2020 Indicizzato Euribor 3 mesi	101,35	—	-0,82	1,67	2,07	1,05	0,55
XS1069508494	Veneto Banca 2014-2019 4%	105,67	—	5,67	11,58	1,10	3,78	0,95
DI SOCIETÀ ESTERE								
NL0009289313	ABN AMRO Bank 2010-2020 Obbligazione Royal Euribor	118,08	6,65	2,56	2,60	2,06	7,32	1,16
NL0009287614	ABN AMRO Bank 2009-2019 4,6%	109,69	4,93	2,12	2,12	2,05	4,26	0,61
NL0009054907	ABN AMRO Bank 2009-2019 5,5%	108,99	4,04	1,61	1,65	1,09	5,10	0,49
FR0011965177	Air France-KLM 2014-2021 3,875%	106,50	—	6,24	8,34	3,11	3,63	2,15

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
XS1048518358	ArcelorMittal 2014-2019 3%	104,90	—	—	15,36	1,08	2,85	0,17
XS1084568762	ArcelorMittal 2014-2020 2,87%	107,00	—	5,15	21,31	3,00	2,68	0,52
XS1214673565	ArcelorMittal 2015-2018 Tasso Variabile	101,50	—	—	10,62	0,09	2,03	0,11
XS1214673722	ArcelorMittal 2015-2021 3%	108,21	—	—	23,96	3,09	2,77	0,78
XS1167308128	ArcelorMittal 2015-2022 3,125%	108,33	—	—	27,58	4,06	2,88	1,23
FR0011560986	Areva 2013-2020 3,25%	104,73	3,97	3,15	5,43	3,02	3,10	1,71
XS0584356942	Bank of America 2011-2026 5,25% Callable	115,33	6,36	3,41	3,40	8,07	4,55	3,18
IT0006703208	Barclays Bank 2009-2019 6%	110,05	3,07	1,41	0,87	2,00	5,45	1,03
IT0006706326	Barclays Bank 2009-2019 Inflation Floored Notes	104,80	3,59	2,22	1,57	2,03	2,86	0,85
FR0012074284	Casino Guichard-Perrachon 2014-2026 4,048%	103,25	—	2,93	13,72	9,01	3,92	3,62
XS1114452060	CNH Industrial Finance Europe 2014-2021 2,875%	108,09	—	5,43	8,81	4,02	2,65	0,92
XS1046851025	CNH Industrial Finance Europe 2014-2019 2,75%	104,33	—	3,89	5,78	1,08	2,63	0,22
XS0604641034	CNH Industrial Finance Europe 2011-2018 6,25%	104,25	3,22	2,88	3,38	0,08	5,99	0,08
XS0842659426	Enel Finance International 2012-2023 4,875%	124,24	7,17	3,60	4,46	5,09	3,92	0,61
XS0827692269	Enel Finance International 2012-2020 4,875%	113,06	5,45	2,13	1,80	2,08	4,31	0,03
XS0177089298	Enel Investment Holding 2003-2023 5,25%	127,80	7,79	3,88	4,40	6,03	4,10	0,69
XS1329671132	Exor 2015-2022 2,125%	106,41	—	—	6,48	5,05	1,99	0,91
XS1119021357	Exor 2014-2024 2,5%	106,30	—	3,39	6,42	7,03	2,35	1,57
XS0953215349	Fiat Chrysler Finance Europe 2013-2019 6,75%	112,86	6,53	5,17	5,67	2,03	5,98	1,04

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
XS1088515207	Fiat Chrysler Finance Europe 2014-2022 4,75%	111,01	—	5,87	6,59	5,00	4,27	2,40
XS1048568452	Fiat Chrysler Finance Europe 2014-2021 4,75%	110,80	—	5,66	6,72	3,08	4,28	1,73
XS0647264398	Fiat Chrysler Finance Europe 2011-2018 7,375%	107,12	4,95	3,93	4,12	1,00	6,88	0,39
XS0906420574	Fiat Chrysler Finance Europe 2013-2018 6,625%	104,47	4,57	3,53	3,45	0,08	6,34	0,28
FR0010014845	GIE PSA Tresorerie 2003-2033 6%	125,79	12,08	10,38	13,32	16,02	4,76	3,83
XS1050842423	Glencore Finance Europe 2014-2026 3,75%	112,20	—	—	33,67	8,09	3,34	2,20
XS0974877150	Glencore Finance Europe 2013-2020 3,375%	108,40	4,93	2,42	22,79	3,03	3,11	0,75
XS1110430193	Glencore Finance Europe 2014-2022 1,625%	99,20	—	1,44	27,72	4,06	1,63	1,81
XS1202849086	Glencore Finance Europe 2015-2025 1,75%	98,99	—	—	37,44	7,08	1,76	1,89
XS0496716282	Italcementi Finance 2010-2020 5,375%	113,62	5,72	3,49	3,18	2,08	4,73	0,33
XS0893201433	Italcementi Finance 2013-2018 6,125%	103,88	4,89	3,29	3,43	0,07	5,80	0,05
XS1308021846	IVS Group 2015-2022 4,5% Callable	105,79	—	—	6,91	5,04	4,25	3,30
DE000A13R8M3	Metro 2014-2021 1,375%	103,65	—	2,71	3,76	4,03	1,32	0,52
XS0975256685	Repsol International Finance 2013-2021 3,625%	115,09	6,04	3,90	8,58	4,03	3,14	0,08
XS0161100515	Telecom Italia Finance 2003-2033 7,75%	139,02	13,02	7,32	9,45	15,06	5,57	4,26
NL0009483825	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 5%	112,70	5,11	2,19	2,19	2,11	4,48	0,69

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-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
			NL0009483833	The Royal Bank of Scotland 2010-2020 Obbligazione Royal 8% Steepener	108,35		4,30	2,96
DE000A1R0410	Thyssenkrupp 2014-2019 3,125%	105,56	—	3,18	4,63	2,03	2,96	0,70
DE000A14J587	Thyssenkrupp 2015-2025 2,5%	105,17	—	—	9,47	7,07	2,37	1,77
DE000A14J579	Thyssenkrupp 2015-2020 1,75%	103,44	—	—	4,90	3,04	1,69	0,72
XS1216647716	Volkswagen Financial Services 2015-2021 0,75%	102,61	—	—	6,11	4,03	0,73	0,14
XS1167644407	Volkswagen International Finance 2015-2023 0,875%	101,60	—	2,73	7,80	5,06	0,86	0,58
XS1167637294	Volkswagen International Finance 2015-2018 Tasso Variabile	99,79	—	—	1,89	1,00	0,28	0,48
XS1167667283	Volkswagen International Finance 2015-2030 1,625%	95,00	—	3,43	7,41	12,06	1,71	2,08
XS1014610254	Volkswagen Leasing 2014-2024 2,625%	110,10	7,83	1,53	6,90	6,06	2,38	1,02
DI ENTI INTERNAZIONALI								
IT0006527300	BEI 1999-2029 Step-Down	179,22	9,91	4,91	4,55	11,08	0,00	3,12
IT0006527052	BEI 1999-2019 Eurostability Bond	129,65	2,57	1,57	0,75	1,07	0,00	0,17
XS0290050524	BEI 2007-2024 4,125%	126,89	5,93	1,66	2,31	6,09	3,25	0,14
XS0807336077	BEI 2012-2025 2,75%	119,36	7,05	1,97	2,32	8,02	2,30	0,35
XS0196448129	BEI 2004-2020 4,625%	114,02	2,89	0,72	0,46	2,09	4,05	-0,36
XS0412826579	BEI 2009-2019 4,25%	108,45	1,91	0,45	0,31	1,09	3,91	-0,44
XS1107718279	BEI 2014-2026 1,25%	106,88	—	2,39	2,33	9,04	1,16	0,50
XS1107247725	BEI 2014-2045 1,75%	104,67	—	—	3,08	28,02	1,67	1,54

OBBLIGAZIONI QUOTATI IN BORSA AL 30 GIUGNO 2017

SECURITIES AND BONDS AT 30th JUNE 2017

Codice ISIN	TITOLO	Quotazione al 30-VI-2017 %	Rendimento % medio annuo lordo realizzato al 30-VI-2017 con un investimento effettuato il			Vita media residua al 30-VI-2017 (anni e mesi)	Rendimento % annuo lordo al corso del 30-VI-2017	
			2-I-2014	2-I-2015	2-I-2016		immediato	effettivo
			XS0878567394	BEI 2013-2018 1%	101,44		1,36	0,16
XS1260085037	BEI 2015-2020 0,125% Ecoop	101,43	—	—	0,58	2,11	0,12	-0,36
XS1288040055	BEI 2015-2020 0,25%	101,42	—	—	0,57	3,03	0,24	-0,18
XS0821238226	BEI 2012-2019 1,875%	100,67	2,57	1,76	1,83	2,03	1,87	1,58
XS1183208328	BEI 2015-2031 1% Ecoop	99,58	—	—	3,41	13,08	1,00	1,03
XS1207449684	BEI 2015-2025 0,125% Earns	98,20	—	—	2,59	7,09	0,12	0,36
EU000A1G0AR0	EFSF 2012-2019 2,625%	105,60	2,01	0,49	0,22	1,10	2,48	-0,40
EU000A1G0DD4	EFSF 2015-2045 1,2%	88,79	—	—	1,51	27,07	1,35	1,71

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO

LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI

AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
DI STATO								
Buoni del Tesoro Poliennali	847.241	68,9	905.946	69,5	1.000.678	72,6	1.092.292	74,4
Certificati di Credito del Tesoro	192.071	15,6	183.673	14,1	165.768	12,0	158.885	10,8
Buoni Ordinari del Tesoro	137.802	11,2	159.303	12,2	143.661	10,4	139.249	9,5
Certificati del Tesoro Zero-Coupon	47.314	3,8	49.484	3,8	63.949	4,6	72.639	4,9
Republic of Italy	4.905	0,4	4.905	0,4	4.905	0,4	4.905	0,3
Certificati di Credito del Tesoro in euroscudi	—	—	—	—	—	—	—	—
<i>Totale</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>1.467.970</i>	<i>100,0</i>
<i>% sul totale generale</i>		<i>50,8</i>		<i>48,7</i>		<i>43,9</i>		<i>42,9</i>
Comunali	40	*	34	*	28	*	22	*
ESTERI								
Regno dei Paesi Bassi	—	—	—	—	—	—	—	—
Regno del Belgio	—	—	—	—	—	—	—	—
Regno di Spagna	103.195	9,5	88.569	7,0	113.803	7,5	134.792	8,5
Repubblica Austriaca	870	0,1	870	0,1	870	0,1	36.850	2,3
Repubblica Ellenica	79.047	7,3	72.162	5,7	134.153	8,8	145.433	9,2
Repubblica Federale Tedesca	521.000	48,2	705.250	56,0	794.250	52,3	713.750	45,0
Repubblica Finlandese	—	—	—	—	—	—	—	—
Repubblica Francese	377.676	34,9	392.285	31,2	476.689	31,4	555.311	35,0
Repubblica Irlandese	—	—	—	—	—	—	—	—
Repubblica Polacca	—	—	—	—	—	—	—	—
Repubblica Portoghese	—	—	—	—	—	—	—	—
<i>Totale</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>1.586.136</i>	<i>100,0</i>
<i>% sul totale generale</i>		<i>44,7</i>		<i>46,9</i>		<i>48,4</i>		<i>46,4</i>
DI ENTI E SOCIETÀ								
2i Rete Gas	—	—	—	—	—	—	—	—
4 Madonne Caseificio dell'Emilia Soc. Coop. Agricola	—	—	—	—	—	—	—	—
A2A	—	—	—	—	1.500	2,1	1.500	1,5
Acea	—	—	—	—	—	—	—	—
Acque del Basso Livenza	—	—	—	—	—	—	—	—
Acque del Chiampo	—	—	—	—	—	—	—	—
Acque Veronesi Scarl.	—	—	—	—	—	—	—	—
Acque Vicentine	—	—	—	—	—	—	—	—
ADR - Aeroporti di Roma	—	—	—	—	—	—	—	—
AGS - Azienda Gardesana Servizi	—	—	—	—	—	—	—	—

31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
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	1.498.003	83,8
143.609	9,4	122.590	7,8	124.717	7,5	120.708	7,1	120.819	7,0	134.719	7,5
141.593	9,3	159.994	10,2	149.879	9,0	133.196	7,8	114.924	6,6	113.613	6,4
69.183	4,5	64.642	4,1	79.507	4,8	50.163	2,9	47.701	2,8	39.607	2,2
4.905	0,3	4.905	0,3	4.905	0,3	4.905	0,3	4.905	0,3	1.905	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
<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>1.787.846</i>	<i>100,0</i>
	<i>41,3</i>		<i>40,7</i>		<i>40,1</i>		<i>35,1</i>		<i>33,7</i>		<i>33,1</i>
13	*	10	*	8	*	5	*	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	83.913	3,6	193.869	7,9	278.311	11,4
—	—	—	—	113.941	6,6	270.738	11,5	262.659	10,7	254.581	10,4
174.980	10,9	162.272	10,3	217.080	12,6	389.633	16,6	397.509	16,2	373.245	15,3
90.719	5,6	90.719	5,7	127.825	7,4	157.011	6,7	151.165	6,2	150.885	6,2
136.623	8,5	176.281	11,1	168.301	9,7	160.301	6,8	160.301	6,5	155.301	6,4
664.500	41,2	600.500	37,9	545.500	31,6	544.250	23,2	511.750	20,9	451.750	18,5
—	—	—	—	—	—	69.003	2,9	72.004	2,9	76.505	3,1
545.099	33,8	553.285	35,0	554.305	32,1	539.250	23,0	504.832	20,6	511.379	21,0
—	—	—	—	—	—	51.045	2,2	96.016	3,9	90.884	3,7
—	—	—	—	—	—	—	—	14.925	0,6	17.925	0,7
—	—	—	—	—	—	82.615	3,5	83.463	3,4	77.778	3,2
<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>2.438.543</i>	<i>100,0</i>
	<i>43,6</i>		<i>40,9</i>		<i>41,5</i>		<i>48,3</i>		<i>47,7</i>		<i>45,1</i>
—	—	—	—	—	—	1.350	0,7	1.350	0,8	1.350	0,8
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	6	*
1.500	0,9	2.250	1,0	2.750	1,2	2.750	1,5	3.050	1,8	2.050	1,2
—	—	—	—	600	0,3	1.200	0,6	1.200	0,7	2.200	1,3
—	—	—	—	—	—	14	*	14	*	14	*
—	—	—	—	—	—	13	*	13	*	13	*
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	26	*
—	—	—	—	600	0,3	600	0,3	600	0,3	600	0,3
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	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		31-XII-2016	
	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	%
Alerion	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	130	0,1	130	0,1
Alessandro Rosso Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*	4	*	4	*	4	*
Alto Vicentino Servizi	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	18	*	18	*	18	*
Antin Solar Investments	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	85	*	83	*	—	—
ASI - Azienda Servizi Integrati	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*
Asja Ambiente Italia	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	12	*	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	3.000	1,7
Astaldi	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,4
Atlantia	—	—	—	—	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	6.000	3,5
ATS - Alto Trevigiano Servizi Srl	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*
Autostade per l'Italia	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.600	1,5	3.200	1,9
Azienda Solare Italiana	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	204	0,1
Banca Adria CC del Delta	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	40	*	40	*	40	*	—	—	—
Banca Agricola Popolare di Ragusa	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	43	*	43	*	43	*	—	—	—
Banca Alpi Marittime CC Carrù	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	48	*	48	*	48	*	—	—	—
Banca Alto Vicentino CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	13	*	13	*	13	*	—	—	—
Banca Apulia	100	0,2	175	0,4	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Area Pratese CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	13	*	13	*	13	*	—	—	—
Banca Atestina CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*	9	*	9	*	—	—	—
Banca Carige	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	825	0,5
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	—	—	—
Banca Cras CC - Chianciano Terme-Costa Etrusca-Sovicille	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	38	*	38	*	38	*	8	*	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	*	—	—	—
Banca del Lavoro e del Piccolo Risparmio	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	—	—	—
Banca del Sud	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	—	—	—
Banca del Valdarno CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	45	*	45	*	—	—	—	—	—
Banca della Bergamasca CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	35	*	35	*	35	*	—	—	—
Banca della Marca CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	90	*	90	*	—	—	—	—	—
Banca della Maremma	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	—	—	—
Banca della Toscana CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	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	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	*	—	—	—
Banca di Anghiari e Stia	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*	—	—	—	—	—
Banca di Bedizzole Turano Valvestino CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	53	*	53	*	53	*	—	—	—
Banca di Bologna CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	120	0,1	120	0,1	90	*	—	—	—
Banca di Capranica CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	10	*	—	—	—
Banca di Carnia e Gemonese CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—	—
Banca di Cascina CC	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	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	50	*	50

1) Già Autostrade.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Banca di Forlì CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Mantignana e di Perugia CC Umbro	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Monastier e del Sile	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Pesaro CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Pescia CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Pistoia CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca di Rimini CC	—	—	—	—	—	—	—	—
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	200	0,3	200	0,4	—	—	—	—
Banca Ifis	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca IMI	123	0,2	301	0,6	1.849	2,6	3.696	3,7
Banca Malatestiana CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Monte dei Paschi di Siena	1.206	2,0	720	1,5	1.418	2,0	2.411	2,4
Banca Nazionale del Lavoro	3.290	5,5	2.784	5,8	1.880	2,6	1.748	1,8
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	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Spoleto	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Popolare di Vicenza	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—
Banca Veronese CC di Concamarise	—	—	—	—	—	—	—	—
Bancasciano CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Banco di Credito P. Azzoaglio	—	—	—	—	—	—	—	—
Banco Popolare	118	0,2	118	—	2.118	2,9	5.644	5,7
BCC Abruzzese - Cappelle Tavo	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC Crediveneto - CC Interprovinciale Veneto	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC dei Castelli Romani	—	—	—	—	—	—	—	—
BCC dei Comuni Cilentani	—	—	—	—	—	—	—	—

31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
—	—	60	*	60	*	—	—	—	—	—	—
—	—	25	*	25	*	—	—	—	—	—	—
100	0,1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	28	*	28	*	—	—	—	—	—	—
—	—	12	*	12	*	—	—	—	—	—	—
—	—	30	*	30	*	30	*	—	—	—	—
—	—	32	*	32	*	32	*	—	—	—	—
—	—	14	*	14	*	—	—	—	—	—	—
—	—	21	*	21	*	—	—	—	—	—	—
—	—	15	*	15	*	—	—	—	—	—	—
—	—	6	*	6	*	6	*	—	—	—	—
—	—	14	*	14	*	—	—	—	—	—	—
—	—	35	*	35	*	—	—	—	—	—	—
100	0,1	500	0,2	500	0,2	170	0,1	170	0,1	170	0,1
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	207	0,1	207	0,1	—	—	—	—	—	—
3.820	2,2	3.893	1,7	3.983	1,8	3.086	1,7	1.589	0,9	2.889	1,7
—	—	100	*	100	*	—	—	—	—	—	—
15.569	9,1	8.200	3,7	5.755	2,6	5.034	2,7	3.838	2,2	3.838	2,2
901	0,5	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	35	*	35	*	35	*	—	—	—	—
—	—	20	*	20	*	20	*	—	—	—	—
—	—	160	0,1	160	0,1	160	0,1	—	—	—	—
750	0,4	1.250	0,6	1.250	0,6	—	—	—	—	—	—
—	—	420	0,2	420	0,2	—	—	—	—	—	—
100	0,1	230	0,1	230	0,1	230	0,1	75	*	75	*
—	—	43	*	43	*	—	—	—	—	—	—
—	—	50	*	50	*	—	—	—	—	—	—
—	—	89	*	89	*	—	—	—	—	—	—
1.000	0,6	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	210	0,1	210	0,1	70	*	70	*	70	*
2.000	1,2	6.550	2,9	6.450	2,9	1.650	0,9	1.650	1,0	1.650	1,0
—	—	168	0,1	168	0,1	—	—	—	—	—	—
—	—	50	*	50	*	50	*	—	—	—	—
—	—	65	*	65	*	65	*	—	—	—	—
—	—	60	*	60	*	—	—	—	—	—	—
—	—	32	*	32	*	—	—	—	—	—	—
—	—	65	*	65	*	65	*	—	—	—	—
—	—	70	*	70	*	—	—	—	—	—	—
—	—	18	*	18	*	—	—	—	—	—	—
150	0,1	150	0,1	150	0,1	—	—	—	—	—	—
—	—	10	*	10	*	—	—	—	—	—	—
—	—	21	*	21	*	21	*	—	—	—	—
—	—	15	*	15	*	—	—	—	—	—	—
11.312	6,6	11.942	5,4	10.365	4,6	10.589	5,7	9.489	5,5	8.239	4,8
—	—	7	*	7	*	7	*	—	—	—	—
—	—	50	*	50	*	30	*	—	—	—	—
—	—	6	*	6	*	6	*	—	—	—	—
—	—	15	*	15	*	—	—	—	—	—	—

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-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
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	—	—	—	—	—	—	—	—
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 Fornacette	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—

31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
—	—	24	*	24	*	—	—	—	—	—	—
—	—	15	*	15	*	—	—	—	—	—	—
—	—	104	*	104	*	104	0,1	—	—	—	—
—	—	39	*	39	*	—	—	—	—	—	—
—	—	15	*	15	*	15	*	—	—	—	—
—	—	4	*	4	*	4	*	—	—	—	—
—	—	30	*	30	*	30	*	—	—	—	—
—	—	20	*	20	*	10	*	—	—	—	—
—	—	5	*	5	*	—	—	—	—	—	—
—	—	30	*	30	*	30	*	—	—	—	—
—	—	102	*	102	*	—	—	—	—	—	—
—	—	100	*	100	*	—	—	—	—	—	—
—	—	22	*	22	*	9	*	—	—	—	—
—	—	47	*	47	*	47	*	—	—	—	—
—	—	22	*	22	*	—	—	—	—	—	—
—	—	43	*	43	*	—	—	—	—	—	—
—	—	10	*	10	*	—	—	—	—	—	—
—	—	150	0,1	150	0,1	—	—	—	—	—	—
—	—	32	*	32	*	32	*	—	—	—	—
—	—	21	*	21	*	—	—	—	—	—	—
—	—	39	*	39	*	—	—	—	—	—	—
—	—	42	*	42	*	—	—	—	—	—	—
—	—	23	*	23	*	—	—	—	—	—	—
—	—	18	*	18	*	—	—	—	—	—	—
—	—	20	*	20	*	20	*	—	—	—	—
—	—	35	*	35	*	—	—	—	—	—	—
—	—	58	*	58	*	18	*	—	—	—	—
—	—	15	*	15	*	—	—	—	—	—	—
—	—	6	*	6	*	—	—	—	—	—	—
—	—	22	*	22	*	22	*	—	—	—	—
—	—	44	*	44	*	—	—	—	—	—	—
—	—	35	*	35	*	—	—	—	—	—	—
—	—	5	*	5	*	5	*	—	—	—	—
—	—	11	*	11	*	—	—	—	—	—	—
—	—	125	0,1	125	0,1	—	—	—	—	—	—
—	—	35	*	35	*	—	—	—	—	—	—
—	—	45	*	45	*	45	*	—	—	—	—
—	—	31	*	31	*	—	—	—	—	—	—
—	—	18	*	18	*	—	—	—	—	—	—
—	—	10	*	10	*	—	—	—	—	—	—
—	—	9	*	9	*	—	—	—	—	—	—
—	—	30	*	30	*	—	—	—	—	—	—
—	—	25	*	25	*	—	—	—	—	—	—
—	—	15	*	15	*	15	*	—	—	—	—
—	—	5	*	5	*	5	*	—	—	—	—
—	—	20	*	20	*	20	*	—	—	—	—
—	—	23	*	23	*	—	—	—	—	—	—
—	—	10	*	10	*	—	—	—	—	—	—
—	—	35	*	35	*	—	—	—	—	—	—

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
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.....	—	—	—	—	—	—	—	—
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..... 1) 2)	889	1,5	804	1,7	753	1,0	753	0,8
Bene Banca - BCC di Bene Vagienna.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BIM Gestione Servizi Pubblici.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BPM.....	—	—	—	—	—	—	—	—
BPRM - Banca della Provincia di Macerata.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Building Energy.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Buscaini Angelo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Buzzi Unicem.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Cap Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—
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.....	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
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	*	—	—	—	—	—	—
BCC di San Giorgio e Meduno.....	—	—	24	*	24	*	—	—	—	—	—	—
BCC di San Giovanni Rotondo.....	—	—	25	*	25	*	—	—	—	—	—	—
BCC di San Marco dei Cavoti e del Sannio.....	—	—	5	*	5	*	5	*	—	—	—	—
BCC di San Marzano di San Giuseppe.....	—	—	9	*	9	*	9	*	—	—	—	—
BCC di Sant'Elena.....	—	—	42	*	42	*	—	—	—	—	—	—
BCC di Scafati e Cetara.....	—	—	7	*	7	*	7	*	—	—	—	—
BCC di Sesto San Giovanni.....	—	—	29	*	29	*	9	*	—	—	—	—
BCC di Signa.....	—	—	35	*	35	*	35	*	—	—	—	—
BCC di Sorisole e Lepreno.....	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—	—	—
BCC di Spello e Bettona.....	—	—	15	*	15	*	—	—	—	—	—	—
BCC di Staranzano e Villesse.....	—	—	12	*	12	*	—	—	—	—	—	—
BCC di Triuggio e della Valle del Lambro.....	—	—	30	*	30	*	—	—	—	—	—	—
BCC di Vergato.....	—	—	7	*	7	*	—	—	—	—	—	—
BCC di Vignole.....	—	—	28	*	28	*	—	—	—	—	—	—
BCC Monte Pruno di Roscigno e di Laurino.....	—	—	12	*	12	*	—	—	—	—	—	—
BCC Picena.....	—	—	34	*	34	*	34	*	—	—	—	—
BCC Pordenonese.....	—	—	60	*	60	*	—	—	—	—	—	—
BCC Sangro Teatina di Atessa.....	—	—	9	*	9	*	—	—	—	—	—	—
BCC Valle Seriana.....	—	—	14	*	14	*	14	*	—	—	—	—
BCC Valmarecchia.....	—	—	25	*	25	*	25	*	—	—	—	—
BCC Vicentino - Pojana Maggiore.....	—	—	35	*	35	*	—	—	—	—	—	—
BDM-MCC - Banca del Mezzogiorno-MedioCredito Centrale..... 1) 2)	652	0,4	652	0,3	498	0,2	—	—	—	—	—	—
Bene Banca - BCC di Bene Vagienna.....	—	—	37	*	37	*	37	*	—	—	—	—
BIM Gestione Servizi Pubblici.....	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	12	*
BPM.....	3.900	2,3	3.150	1,4	2.650	1,2	2.704	1,4	2.650	1,5	1.900	1,1
BPRM - Banca della Provincia di Macerata.....	—	—	10	*	10	*	10	*	—	—	—	—
Building Energy.....	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*
Buscaini Angelo.....	—	—	—	—	10	*	10	*	—	—	—	—
Buzzi Unicem.....	—	—	—	—	—	—	—	—	350	0,2	500	0,3
Cap Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*
Carichieti - Cassa di Risparmio della Provincia di Chieti.....	—	—	180	0,1	180	0,1	180	0,1	60	*	60	*
Carifermo - Cassa di Risparmio di Fermo.....	—	—	70	*	70	*	—	—	—	—	—	—
Cartiere Villa Lagarina.....	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*
Cassa Centrale BCC del Nord Est.....	—	—	150	0,1	150	0,1	—	—	—	—	—	—
Cassa Centrale Raiffeisen dell'Alto Adige.....	—	—	160	0,1	160	0,1	160	0,1	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Bolzano.....	—	—	600	0,3	600	0,3	200	0,1	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Bra.....	—	—	50	*	50	*	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Cento.....	150	0,1	90	*	90	*	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Cesena.....	—	—	300	0,1	300	0,1	—	—	—	—	—	—
Cassa di Risparmio di Ferrara.....	375	0,2	375	0,2	375	0,2	375	0,2	125	0,1	125	0,1
Cassa di Risparmio di Ravenna.....	—	—	270	0,1	270	0,1	—	—	—	—	—	—

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-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
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.....	—	—	—	—	—	—	—	—
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	—	—	—	—	—	—	—	—
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 Seregno 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 Cremonese	—	—	—	—	—	—	—	—

31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
—	—	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	*	—	—	—	—	—	—
—	—	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	*	—	—	—	—	—	—

1) Gli importi indicati includono quelli relativi a B.C.C. di Campiglia dei Berici (7,5 nel 2012 e nel 2013), incorporata nel I-2014.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	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		31-XII-2016	
	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	%
CC Mediocrati.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	19	*	19	*	19	*	—	—	—	—
CDP..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.550	1,4	5.550	3,2	5.550	3,2
Centro Leasing Banca..... ²⁾	90	0,2	90	0,2	90	0,1	90	0,1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
Centro Veneto Servizi.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	29	*	29	*	29	*
Centromarca Banca CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	20	*	20	*	—	—	—	—
Cerved Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	780	0,3	530	0,3	530	0,3	—	—
Chiantibanca BCC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	106	*	106	*	—	—	—	—	—	—
CMC di Ravenna.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	300	0,2	300	0,2	300	0,2
CMD - Costruzioni Motori Diesel.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*
Coesia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	100	0,1	100	0,1	100	0,1	
Cogemat.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	51	*	22	*	22	*	
Coleman.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*	8	*
Corvallis Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*	8	*	
Coswell.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*	
CRA di Treviso - Cassa Rurale ed Artigiana di Treviso CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Credem.....	459	0,8	368	0,8	366	0,5	296	0,3	1.026	0,6	956	0,4	886	0,4	354	0,2	252	0,1	80	*
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..... ³⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Davide Campari Milano.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	400	0,2	400	0,2	400	0,2	1.000	0,6	1.000	0,6
Dedagroup.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	10	*	—
Dexia Crediop..... ⁴⁾	4.828	8,1	5.859	12,2	5.165	7,2	4.614	4,7	5.979	3,5	5.177	2,3	4.881	2,2	4.204	2,2	2.859	1,7	2.058	1,2
Dynamica Retail.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	—
Edison.....	—	—	—	—	1.400	1,9	1.800	1,8	1.800	1,1	1.800	0,8	1.800	0,8	1.100	0,6	600	0,3	600	0,3
Efibanca.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	118	0,1	41	*	—	—	—	—	—	—
EGEA - Ente Gestione Energia e Ambiente.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	—
EMIL Banca CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	114	0,1	114	0,1	—	—	—	—	—	—
Enel.....	3.300	5,5	3.300	6,9	4.800	6,7	8.800	8,9	10.300	6,0	12.300	5,5	11.550	5,1	11.400	6,1	9.100	5,3	6.100	3,5
Energetica Srl.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Enertronica.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*
Enerventi.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*	8	*	7	*	—
Eni.....	—	—	—	—	5.000	6,9	7.000	7,1	11.075	6,5	12.825	5,8	13.225	5,9	14.225	7,6	13.975	8,1	15.475	9,0
ESTRA.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	50	*	50	*	50	*	—
ETRA - Energia Territorio Risorse Ambientali.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	30	*	30	*	—
Etrion.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	35	*	33	*	—
Eurotranciatura.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	—
Exor.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	940	0,5	1.690	1,0	1.690	1,0	—
Exprivia Health It.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	4	*	—	—	—
FAB Srl.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*	—
Ferrarini.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	30	*	35	*	—
Ferrovie dello Stato.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,3	1.350	0,7	1.350	0,8	1.350	0,8
Filca Cooperative.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	12	*	16	*	16	*	—
Finanziaria Internazionale Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	5	*	40	*
First Capital.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*	9	*	—

1) Gli importi indicati includono quelli relativi alla CDP (2.500 nel 2014 e 4.800 nel 2015 e nel 2016) e alla CDP RETI (750 nel 2015 e nel 2016). - 2) Gruppo Intesa Sanpaolo. - 3) Gruppo Tenaris. - 4) Già Crediop.

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Fnm	—	—	—	—	—	—	—	—
FRI-EL Green Power Srl	—	—	—	—	—	—	—	—
Gamenet	—	—	—	—	—	—	—	—
Geodata Engineering	—	—	—	—	—	—	—	—
Gestione Piccini Srl	—	—	—	—	—	—	—	—
Global Display Solutions	—	—	—	—	—	—	—	—
Global System International	—	—	—	—	—	—	—	—
Gpi	—	—	—	—	—	—	—	—
Gruppo Bancario Iccrea ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Gruppo PSC	—	—	—	—	—	—	—	—
Guala Closures	—	—	—	—	—	—	—	—
HDM	—	—	—	—	—	—	—	—
Hera	—	—	—	—	—	—	—	—
Iacobucchi HF Aerospace	—	—	—	—	—	—	—	—
IBL Banca - Istituto Bancario del Lavoro	—	—	—	—	—	—	—	—
ICM	—	—	—	—	—	—	—	—
Imi Fabi	—	—	—	—	—	—	—	—
Indesit Company	—	—	—	—	—	—	—	—
Industrial	—	—	—	—	—	—	—	—
INGlass	—	—	—	—	—	—	—	—
Innovatec	—	—	—	—	—	—	—	—
Intek Group	—	—	—	—	—	—	—	—
Interbanca	176	0,3	114	0,2	62	0,1	62	0,1
Intesa Sanpaolo ^{3) 4)}	13.446	22,6	8.493	17,6	8.627	12,0	15.824	16,0
Ipi	—	—	—	—	—	—	—	—
IREN	—	—	—	—	—	—	—	—
Irfis - Mediocredito della Sicilia ⁵⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Isaia & Isaia	—	—	—	—	—	—	—	—
Istituto di Credito Sportivo	—	—	—	—	—	—	—	—
IVS Italia	—	—	—	—	—	—	—	—
Landi Renzo	—	—	—	—	—	—	—	—
LEGO - Legatoria Editoriale Giovanni Olivetto	—	—	—	—	—	—	—	—
Leonardo ⁶⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
L'Isolante K-Flex	—	—	—	—	—	—	—	—
Ligabue	—	—	—	—	—	—	—	—
Lucart	—	—	—	—	—	—	—	—
Luxottica	—	—	—	—	—	—	500	0,5
Mantovabanca 1896 CC	—	—	—	—	—	—	—	—
Manucoop Facility Management	—	—	—	—	—	—	—	—
Marcolin	—	—	—	—	—	—	—	—
MCC - Mediocredito Centrale	—	—	—	—	—	—	—	—
Mediobanca	4.994	8,4	5.205	10,9	10.851	15,1	11.945	12,1
Mediocredito del Friuli Venezia Giulia	—	—	—	—	—	—	—	—
Mediocredito Trentino Alto Adige	—	—	—	—	—	—	—	—
MEP	—	—	—	—	—	—	—	—
Mercedes-Benz Financial Services Italia	—	—	—	—	—	—	—	—
Meridie	—	—	—	—	—	—	—	—
Micoperi	—	—	—	—	—	—	—	—
Mille Uno ⁷⁾	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Fnm	—	—	—	—	—	—	—	—	58	*	58	*
FRI-EL Green Power Srl	—	—	—	—	—	—	12	*	12	*	12	*
Gamenet	—	—	—	—	200	0,1	200	0,1	200	0,1	200	0,1
Geodata Engineering	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*	6	*
Gestione Piccini Srl	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Global Display Solutions	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	9	*
Global System International	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*
Gpi	—	—	—	—	—	—	10	*	12	*	27	*
Gruppo Bancario Iccrea ¹⁾	940	0,6	940	0,4	1.440	0,6	500	0,3	500	0,3	—	—
Gruppo PSC	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	15	*
Guala Closures	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	510	0,3
HDM	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*
Hera	—	—	—	—	500	0,2	1.000	0,5	1.000	0,6	2.600	1,5
Iacobucchi HF Aerospace	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	—	—
IBL Banca - Istituto Bancario del Lavoro	—	—	—	—	62	*	62	*	62	*	—	—
ICM	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	24	*
Imi Fabi	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*	23	*
Indesit Company	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	300	0,2
Industrial	—	—	—	—	—	—	—	—	27	*	39	*
INGlass	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*	—	—
Innovatec	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*
Intek Group	—	—	53	*	53	*	53	*	102	0,1	102	0,1
Interbanca	62	*	62	*	62	*	62	*	62	*	62	*
Intesa Sanpaolo ^{3) 4)}	32.570	19,1	33.405	15,0	35.308	15,7	23.403	12,5	25.653	14,8	21.903	12,7
Ipi	—	—	—	—	—	—	—	—	20	*	20	*
IREN	—	—	—	—	—	—	—	—	300	0,2	800	0,5
Irfis - Mediocredito della Sicilia ⁵⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Isaia & Isaia	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*
Istituto di Credito Sportivo	—	—	—	—	170	0,1	170	0,1	170	0,1	—	—
IVS Italia	—	—	—	—	—	—	200	0,1	254	0,1	254	0,1
Landi Renzo	—	—	—	—	—	—	—	—	34	*	29	*
LEGO - Legatoria Editoriale Giovanni Olivetto	—	—	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*
Leonardo ⁶⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,3	3.100	1,8
L'Isolante K-Flex	—	—	—	—	—	—	—	—	100	0,1	280	0,2
Ligabue	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*
Lucart	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Luxottica	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	*	—	—	—	—
Manucoop Facility Management	—	—	—	—	—	—	425	0,2	425	0,2	425	0,2
Marcolin	—	—	—	—	—	—	200	0,1	200	0,1	200	0,1
MCC - Mediocredito Centrale	—	—	—	—	—	—	498	0,2	463	0,2	440	0,3
Mediobanca	4.994	8,4	5.205	10,9	10.851	15,1	11.945	6,3	7.286	4,2	6.222	3,6
Mediocredito del Friuli Venezia Giulia	—	—	—	—	—	—	—	—	195	0,1	65	*
Mediocredito Trentino Alto Adige	—	—	—	—	—	—	—	—	185	0,1	185	0,1
MEP	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	—	—
Mercedes-Benz Financial Services Italia	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	150	0,1
Meridie	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Micoperi	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*	4	*
Mille Uno ⁷⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	35	*
	—	—	—	—	—	—	9	*	9	*	7	*

1) 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 BancaImpresa (650 nel 2011, nel 2012 e nel 2013). - 2) Gruppo GE Commercial Finance. - 3) Già Banco Ambrosiano Veneto, poi Banca Intesa, dopo IntesaBci, quindi Banca Intesa. - 4) 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). - 5) Già Finmeccanica. - 6) Gruppo Poste Italiane. - 7) 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-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Mittel.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Molinari.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Net Insurance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
NoemaLife.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Officine Maccaferri.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Olsa.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Operatori Sanitari Associati.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Oxon Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Pasta Zara.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Pirelli & C.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Polesine Acque.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Poste Italiane.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Prysmian.....	—	—	—	—	—	400	0,4	—
Proma.....	—	—	—	—	—	—	—	—
QS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Rai - Radiotelevisione Italiana.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Renco Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Rhino Bondco.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Rigoni di Asiago.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Romagna Est BCC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Rovigobanca CC.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sace BT.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Salini Impregilo..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Sara Assicurazioni.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SCCI - Società di Cartolarizzazione dei Crediti INPS.....	8.550	14,3	5.125	10,7	3.075	4,3	1.500	1,5
Schumann.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SCIC - Società di Cartolarizzazione Italiana Crediti.....	1.277	2,1	760	1,6	197	0,3	62	0,1
Selle Royal.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Settentrionale Trasporti.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SGG Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SIAS.....	—	—	—	—	—	500	0,5	—
SIGIT - Società Italiana Gomma Industriale Torino.....	—	—	—	—	—	—	—	—
SIPCAM - Società Italiana Prodotti Chimici e per l'Agricoltura Milano.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sisal Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Snam.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Soletto.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sonnedix Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Sudcommerci.....	—	—	—	—	—	—	—	—
TBS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Teamsystem Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Tecno.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Tecnocap.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Telecom Italia.....	2.000	3,3	2.000	4,2	3.250	4,5	5.000	5,1
Tercas - Cassa di Risparmio della Provincia di Teramo.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Terna.....	—	—	—	—	—	—	—	—
TerniEnergia.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Terre Cortesi Moncaro Sca.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Tesmec.....	—	—	—	—	—	—	—	—

1) Già Salini Costruttori.

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016		
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	
Mittel.....	—	—	—	—	100	*	100	0,1	100	0,1	100	0,1	
Molinari.....	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	5	*	
Net Insurance.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	
NoemaLife.....	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	
Officine Maccaferri.....	—	—	—	—	—	—	198	0,1	198	0,1	188	0,1	
Olsa.....	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	10	*	
Operatori Sanitari Associati.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	
Oxon Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*	
Pasta Zara.....	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	
Pirelli & C.....	500	0,3	500	0,2	500	0,2	500	0,3	500	0,3	—	—	
Polesine Acque.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	12	*	
Poste Italiane.....	—	—	—	—	750	0,3	750	0,4	750	0,4	750	0,4	
Prysmian.....	400	0,2	400	0,2	400	0,2	400	0,2	750	0,4	750	0,4	
Proma.....	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	
QS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	5	*	
Rai - Radiotelevisione Italiana.....	—	—	—	—	—	—	—	—	350	0,2	350	0,2	
Renco Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*	
Rhino Bondco.....	—	—	—	—	413	0,2	462	0,2	463	0,3	500	0,3	
Rigoni di Asiago.....	—	—	—	—	—	—	7	*	7	*	7	*	
Romagna Est BCC.....	—	—	—	—	50	*	50	*	—	—	—	—	
Rovigobanca CC.....	—	—	—	—	26	*	26	*	—	—	—	—	
Sace BT.....	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	
Salini Impregilo..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	400	0,2	400	0,2	828	0,5	
Sara Assicurazioni.....	—	—	—	—	—	—	—	—	15	*	14	*	
SCCI - Società di Cartolarizzazione dei Crediti INPS.....	8.550	14,3	5.125	10,7	3.075	4,3	1.500	1,5	—	—	—	—	
Schumann.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	724	0,4	
SCIC - Società di Cartolarizzazione Italiana Crediti.....	1.277	2,1	760	1,6	197	0,3	62	0,1	—	—	—	—	
Selle Royal.....	—	—	—	—	—	—	—	10	*	10	*		
Settentrionale Trasporti.....	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	—	—	
SGG Holding.....	—	—	—	—	—	—	—	8	*	8	*		
SIAS.....	500	0,3	500	0,2	500	0,2	500	0,3	500	0,3	500	0,3	
SIGIT - Società Italiana Gomma Industriale Torino.....	—	—	—	—	—	—	—	6	*	6	*	5	*
SIPCAM - Società Italiana Prodotti Chimici e per l'Agricoltura Milano.....	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*
Sisal Group.....	—	—	—	—	—	—	271	0,1	271	0,1	271	0,2	
Snam.....	—	—	—	—	—	—	6.000	2,7	7.500	3,3	9.100	4,9	
Soletto.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Sonnedix Italia.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	95	0,1
Sudcommerci.....	—	—	—	—	—	—	22	*	22	*	22	*	
TBS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*
Teamsystem Holding.....	—	—	—	—	—	—	300	0,1	557	0,3	558	0,3	
Tecno.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Tecnocap.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*	
Telecom Italia.....	7.750	4,6	9.000	4,0	10.907	4,9	12.020	6,4	12.270	7,1	13.170	7,7	
Tercas - Cassa di Risparmio della Provincia di Teramo.....	40	*	340	0,2	300	0,1	—	—	—	—	—	—	—
Terna.....	1.250	0,7	2.500	1,1	2.500	1,1	2.500	1,3	3.500	2,0	5.050	2,9	
TerniEnergia.....	—	—	—	—	—	—	—	25	*	25	*	25	*
Terre Cortesi Moncaro Sca.....	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*	—	—	
Tesmec.....	—	—	—	—	—	—	—	15	*	15	*	15	*

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
TIP	—	—	—	—	—	—	—	—
Trefin	—	—	—	—	—	—	—	—
Trevi Finanziaria Industriale	—	—	—	—	—	—	—	—
TS Energy Italy	—	—	—	—	—	—	—	—
Twin Set - Simona Barbieri	—	—	—	—	—	—	—	—
UBI Banca	1.232	2,1	961	2,0	3.150	4,4	5.970	6,0
UGF	—	—	—	—	750	1,0	750	0,8
UniCredit	12.895	21,4	9.968	20,8	12.020	16,7	12.224	12,3
United Brands Company	—	—	—	—	—	—	—	—
Veneto Banca	—	—	—	—	—	—	—	—
Vibanca - BCC di S. Pietro in Vincio	—	—	—	—	—	—	—	—
Waste Italia	—	—	—	—	—	—	—	—
Wolfank Systems	—	—	—	—	—	—	—	—
Yachtline Arredomare 1618	—	—	—	—	—	—	—	—
<i>Totale</i>	59.797	100,0	47.955	100,0	72.099	100,0	98.989	100,0
<i>% sul totale generale</i>		2,5		1,8		2,3		2,9
<i>di cui:</i>								
<i>Assicurative e bancarie</i>	44.670	74,7	36.770	76,7	51.378	71,3	68.927	69,6
<i>Industriali</i>	15.127	25,3	11.185	23,3	20.722	28,7	30.062	30,4
DI ENTI INTERNAZIONALI								
BEI - Banca Europea per gli Investimenti	32.596	96,1	55.226	97,6	66.500	98,3	66.114	98,3
BERS - Banca Europea per la Ricostruzione e lo Sviluppo	601	1,8	601	1,1	601	0,9	601	0,9
BIRS - Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo	225	0,7	220	0,4	75	0,1	75	0,1
CEDB - Council of Europe Development Bank	265	0,8	265	0,5	265	0,4	265	0,4
EFSF - European Financial Stability Facility	—	—	—	—	—	—	—	—
ESM - European Stability Mechanism	—	—	—	—	—	—	—	—
EU - European Union	—	—	—	—	—	—	—	—
IDB - Inter-American Development Bank	207	0,6	207	0,4	207	0,3	207	0,3
<i>Totale</i>	33.894	100,0	56.519	100,0	67.647	100,0	67.262	100,0
<i>% sul totale generale</i>		1,4		2,1		2,2		2,0
DI SOCIETÀ ESTERE								
Abb Finance Bv	—	—	—	—	—	—	—	—
Abbey National Financial Services	—	—	—	—	—	—	—	—
ABN Amro Bank	1.487	9,7	1.477	8,5	4.469	4,3	5.834	2,9
Accor	—	—	—	—	—	—	—	—
Achmea Bank	—	—	—	—	—	—	—	—

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
TIP	—	—	—	—	—	—	100	0,1	100	0,1	100	0,1
Trefin	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4	*
Trevi Finanziaria Industriale	—	—	—	—	—	—	50	*	50	*	50	*
TS Energy Italy	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	39	*
Twin Set - Simona Barbieri	—	—	—	—	—	—	150	0,1	150	0,1	150	0,1
UBI Banca	9.615	5,6	15.107	6,8	13.072	5,8	5.893	3,2	4.710	2,7	5.270	3,1
UGF	750	0,4	1.350	0,6	1.350	0,6	1.850	1,0	2.450	1,4	2.450	1,4
UniCredit	20.134	11,8	34.591	15,5	30.257	13,5	18.640	10,0	16.980	9,8	15.832	9,2
United Brands Company	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Veneto Banca	1.500	0,9	1.500	0,7	1.700	0,8	2.550	1,4	1.450	0,8	1.150	0,7
Vibanca - BCC di S. Pietro in Vincio	—	—	16	*	16	*	16	*	—	—	—	—
Waste Italia	—	—	—	—	—	—	200	0,1	200	0,1	200	0,1
Wolfank Systems	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
Yachtline Arredomare 1618	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5	*
<i>Totale</i>	170.292	100,0	222.971	100,0	224.285	100,0	186.961	100,0	172.883	100,0	172.132	100,0
<i>% sul totale generale</i>		4,6		5,8		5,4		3,8		3,4		3,2
<i>di cui:</i>												
<i>Assicurative e bancarie</i>	131.718	77,3	167.674	75,2	158.230	70,5	107.894	57,7	86.629	50,1	78.730	45,7
<i>Industriali</i>	38.575	22,7	55.298	24,8	66.055	29,5	79.067	42,3	86.254	49,9	93.402	54,3
DI ENTI INTERNAZIONALI												
BEI - Banca Europea per gli Investimenti	83.434	63,7	94.350	43,1	104.887	41,4	104.576	34,7	100.826	31,7	102.095	32,1
BERS - Banca Europea per la Ricostruzione e lo Sviluppo	551	0,4	339	0,2	339	0,1	339	0,1	339	0,1	339	0,1
BIRS - Banca Internazionale per la Ricostruzione e lo Sviluppo	75	0,1	75	*	75	*	75	*	75	*	75	*
CEDB - Council of Europe Development Bank	265	0,2	265	0,1	265	0,1	1.265	0,4	1.265	0,4	1.265	0,4
EFSF - European Financial Stability Facility	16.000	12,2	88.200	40,3	111.900	44,2	125.400	41,7	129.150	40,6	125.150	39,4
ESM - European Stability Mechanism	—	—	—	—	—	—	23.988	8,0	45.488	14,3	52.500	16,5
EU - European Union	30.350	23,2	35.650	16,3	35.650	14,1	45.110	15,0	40.710	12,8	35.960	11,3
IDB - Inter-American Development Bank	207	0,2	207	0,1	207	0,1	207	0,1	207	0,1	207	0,1
<i>Totale</i>	130.882	100,0	219.085	100,0	253.322	100,0	300.958	100,0	318.059	100,0	317.590	100,0
<i>% sul totale generale</i>		3,5		5,7		6,1		6,2		6,2		5,9
DI SOCIETÀ ESTERE												
Abb Finance Bv	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.950	0,3
Abbey National Financial Services	—	—	—	—	—	—	—	—	3.500	0,8	3.500	0,5
ABN Amro Bank	4.577	1,8	4.111	1,5	4.111	1,4	1.384	0,4	2.957	0,6	2.809	0,4
Accor	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
Achmea Bank	—	—	—	—	—	—	—	—	1.150	0,2	1.150	0,2

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. - 4) Appartenente al World Bank Group. - 5) 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, 2.431 nel 2015 e 2.679 nel 2016) ed ABN Amro Holding (725 nel 2009, 1.730 nel 2010 e nel 2011, 1.530 nel 2012 e nel 2013, 661 nel 2014, 526 nel 2015 e 130 nel 2016).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO
LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI
AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Adecco International Financial Services	—	—	—	—	—	—	—	—
Adidas	—	—	—	—	500	0,5	500	0,3
Air Liquide Finance	—	—	—	—	—	—	—	—
Air France-KLM	—	—	—	—	700	0,7	700	0,4
Airbus Group Finance	—	—	—	—	—	—	—	—
Allianz Finance	—	—	—	—	—	—	—	—
Allied Irish Banks	—	—	—	—	—	—	—	—
Alstom	—	—	—	—	—	—	—	—
American Honda Finance	—	—	—	—	750	0,7	750	0,4
Anglo American Capital	—	—	—	—	—	—	—	—
Anheuser-Busch Inbev	—	—	—	—	—	—	—	—
ArcelorMittal	—	—	—	—	—	—	—	—
Areva	—	—	—	—	—	—	—	—
Astrazeneca	—	—	—	—	—	—	—	—
Axa	—	—	—	—	—	—	—	—
Bank of America Corporation	—	—	—	—	—	—	2.000	1,0
Bank of Ireland	—	—	—	—	—	—	—	—
Banque PSA Finance	—	—	—	—	—	—	2.600	1,3
Barclays Bank	—	—	229	1,3	989	1,0	6.745	3,4
Basf	—	—	—	—	—	—	—	—
BAT International Finance	—	—	—	—	650	0,6	650	0,3
Bayer	—	—	—	—	—	—	1.300	0,7
Bayerische Hypo-und Vereinsbank	3.255	21,2	1.204	6,9	—	—	—	—
BBVA - Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	—	—	—	—	—	—	2.250	1,1
Bertelsmann SE & Co. KgaA	—	—	—	—	—	—	—	—
BFCM - Banque Fédérative du Crédit Mutuel	—	—	—	—	—	—	—	—
BMW Finance	—	—	—	—	3.000	2,9	6.750	3,4
BNP Paribas	—	—	—	—	51	*	1.551	0,8
BP Capital Markets	—	—	—	—	—	—	2.000	1,0
British American Tobacco Holdings	—	—	—	—	—	—	—	—
British Sky Broadcasting Group	—	—	—	—	—	—	—	—
British Telecommunications	—	—	—	—	—	—	—	—
Carlsberg Breweries	—	—	—	—	—	—	1.000	0,5
Carrefour	—	—	—	—	—	—	—	—
Casino Guichard Perrachon	—	—	—	—	—	—	—	—
Cellnex Telecom	—	—	—	—	—	—	—	—
Ceske Energeticke Zavody	—	—	—	—	—	—	750	0,4
Ciba Specialty Chemicals Finance Luxembourg	—	—	—	—	—	—	—	—
Citigroup	—	—	—	—	—	—	1.348	0,7
Coca-Cola Hbc Finance	—	—	—	—	—	—	—	—
Commerzbank	—	—	—	—	—	—	—	—
Commonwealth Bank Of Australia	—	—	—	—	—	—	—	—
Compagnie de Saint-Gobain	—	—	—	—	—	—	750	0,4
Conti-Gummi Finance	—	—	—	—	—	—	—	—
Continental	—	—	—	—	—	—	—	—
Continental Rubber of America	—	—	—	—	—	—	—	—
Crédit Agricole	—	—	—	—	—	—	274	0,1
Credit Suisse	—	—	—	—	900	0,9	3.175	1,6
DaimlerChrysler	—	—	—	—	4.000	3,9	7.700	3,9

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Adecco International Financial Services	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
Adidas	500	0,2	500	0,2	500	0,2	1.000	0,3	1.000	0,2	1.000	0,1
Air Liquide Finance	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
Air France-KLM	700	0,3	700	0,3	700	0,2	1.300	0,4	1.300	0,3	1.500	0,2
Airbus Group Finance	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1	2.000	0,3
Allianz Finance	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	3.750	0,5
Allied Irish Banks	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
Alstom	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2	750	0,1
American Honda Finance	750	0,3	750	0,3	750	0,3	—	—	—	—	—	—
Anglo American Capital	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	5.813	0,8
Anheuser-Busch Inbev	—	—	—	—	750	0,3	750	0,2	3.000	0,6	15.000	2,2
ArcelorMittal	—	—	—	—	—	—	600	0,2	3.000	0,6	3.000	0,4
Areva	—	—	—	—	500	0,2	500	0,2	500	0,1	4.579	0,7
Astrazeneca	—	—	—	—	—	—	750	0,2	750	0,2	750	0,1
Axa	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
Bank of America Corporation	2.154	0,8	2.141	0,8	2.139	0,7	5.888	1,8	8.626	1,8	11.376	1,6
Bank of Ireland	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2	750	0,1
Banque PSA Finance	4.350	1,7	4.950	1,8	4.800	1,7	3.000	0,9	1.000	0,2	—	—
Barclays Bank	6.285	2,4	5.329	2,0	2.855	1,0	5.321	1,7	3.280	0,7	6.464	0,9
Basf	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	3.200	0,5
BAT International Finance	650	0,3	650	0,2	650	0,2	650	0,2	4.250	0,9	4.250	0,6
Bayer	1.300	0,5	1.300	0,5	1.300	0,5	2.000	0,6	2.000	0,4	1.500	0,2
Bayerische Hypo-und Vereinsbank	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
BBVA - Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	3.250	1,3	2.250	0,8	3.750	1,3	2.750	0,9	1.500	0,3	2.500	0,4
Bertelsmann SE & Co. KgaA	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1	500	0,1
BFCM - Banque Fédérative du Crédit Mutuel	—	—	—	—	—	—	—	—	4.000	0,9	7.250	1,0
BMW Finance	11.150	4,3	8.900	3,3	8.900	3,1	9.000	2,8	15.750	3,4	19.250	2,8
BNP Paribas	3.500	1,4	4.750	1,8	4.750	1,7	4.750	1,5	6.250	1,3	14.650	2,1
BP Capital Markets	2.000	0,8	2.000	0,7	2.600	0,9	5.600	1,7	8.100	1,7	11.025	1,6
British American Tobacco Holdings	600	0,2	600	0,2	600	0,2	—	—	—	—	—	—
British Sky Broadcasting Group	—	—	—	—	—	—	2.000	0,6	2.000	0,4	2.000	0,3
British Telecommunications	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	3.900	0,6
Carlsberg Breweries	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,4	2.000	0,6	2.000	0,4	2.000	0,3
Carrefour	—	—	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,3	1.000	0,2	1.000	0,1
Casino Guichard Perrachon	—	—	—	—	—	—	2.450	0,8	2.450	0,5	2.450	0,4
Cellnex Telecom	—	—	—	—	—	—	—	—	600	0,1	1.350	0,2
Ceske Energeticke Zavody	750	0,3	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2	750	0,1
Ciba Specialty Chemicals Finance Luxembourg	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
Citigroup	3.855	1,5	3.823	1,4	3.815	1,3	8.065	2,5	6.781	1,5	11.750	1,7
Coca-Cola Hbc Finance	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.400	0,2
Commerzbank	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.000	0,3
Commonwealth Bank Of Australia	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,1
Compagnie de Saint-Gobain	2.500	1,0	2.500	0,9	2.500	0,9	2.500	0,8	1.500	0,3	1.500	0,2
Conti-Gummi Finance	—	—	—	—	750	0,3	750	0,2	750	0,2	750	0,1
Continental	—	—	—	—	750	0,3	750	0,2	750	0,2	750	0,1
Continental Rubber of America	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
Crédit Agricole	274	0,1	274	0,1	274	0,1	1.774	0,6	5.274	1,1	7.500	1,1
Credit Suisse	3.175	1,2	2.882	1,1	2.755	1,0	10.223	3,2	16.250	3,5	18.765	2,7
DaimlerChrysler	6.700	2,6	6.750	2,5	8.000	2,8	5.750	1,8	7.500	1,6	19.050	2,8

1) 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, 2.273 nel 2015 e 3.964 nel 2016) e Barclays (900 nel 2010, 820 nel 2011, 383 nel 2012, 343 nel 2013, 1.334 nel 2014, 1.000 nel 2015 e 2.500 nel 2016). - 2) Gli importi indicati includono quelli relativi a Bayer Capital Corporation (1.300 nel 2013) e Bayer (2.000 nel 2014). - 3) 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, nel 2015 e nel 2016) e BBVA (1.250 nel 2010, nel 2011, nel 2012, nel 2013, nel 2014 e nel 2016). - 4) 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, 12.750 nel 2015 e 16.250 nel 2016) e BMW US Capital (750 nel 2009, nel 2010, nel 2011 e nel 2012, 3.000 nel 2015 e 3.000 nel 2016). - 5) 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 2012 e nel 2013, 8.000 nel 2014, 6.750 nel 2015 e 11.750 nel 2016). - 6) Gruppo Continental. - 7) Gli importi indicati includono quelli relativi a Crédit Agricole (274 nel 2013 e nel 2014, 2.274 nel 2015 e 2.000 nel 2016) e Crédit Agricole Filiale del Regno Unito (1.500 nel 2014, 3.000 nel 2015 e 5.500 nel 2016). - 8) 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, 3.500 nel 2015 e nel 2016) 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, 12.750 nel 2015 e 15.265 nel 2016). - 9) 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, 7.500 nel 2015 e 19.050 nel 2016).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO

LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI

AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Danone Groupe.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Danske Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Bahn Finance.....	2.350	15,3	2.350	13,6	1.000	1,0	500	0,3
Deutsche Bank.....	—	—	—	—	—	—	1.043	0,5
Deutsche Boerse.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Lufthansa.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Post..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Postbank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Deutsche Telekom International Finance.....	—	—	—	—	6.500	6,3	8.250	4,2
Diageo Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Dresdner Bank..... ²⁾	462	3,0	462	2,7	200	0,2	200	0,1
DS Smith.....	—	—	—	—	—	—	—	—
DVB Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
E.On International Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
EDF - Electricité de France.....	—	—	—	—	—	—	—	—
EDP Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Enagas Financiaciones.....	—	—	—	—	—	—	—	—
EnBW International Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
ENEL Finance International..... ³⁾	—	—	—	—	4.300	4,2	4.300	2,2
Engie..... ^{4) 5)}	—	—	—	—	650	0,6	2.000	1,0
Eurogrid.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Eutelsat.....	—	—	—	—	—	—	850	0,4
FCA Capital Ireland..... ⁶⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
FCE Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Fe New.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Fiat Chrysler Automobiles.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Fiat Chrysler Finance Europe..... ⁷⁾	2.794	18,2	2.670	15,4	6.547	6,3	5.423	2,7
Finmeccanica Finance.....	—	—	—	—	1.800	1,7	2.300	1,2
General Electric Capital Corporation..... ⁸⁾	—	—	—	—	13.750	13,3	16.750	8,4
GIE PSA Trésorerie.....	—	—	—	—	600	0,6	600	0,3
GlaxoSmithKline Capital.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Glencore Finance Europe.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Goldman Sachs Group..... ⁹⁾	1.432	9,3	1.432	8,3	1.432	1,4	883	0,4
Heineken.....	—	—	—	—	—	—	—	—
HSBC Bank..... ¹⁰⁾	—	—	—	—	1.250	1,2	2.750	1,4
Iberdrola..... ¹¹⁾	—	—	—	—	—	—	1.250	0,6
IBM - International Business Machine Corporation.....	—	—	—	—	1.000	1,0	—	—
Infineon Technologies.....	—	—	—	—	—	—	—	—
ING Bank.....	—	—	—	—	—	—	1.250	0,6
Instituto de Credito Oficial.....	—	—	—	—	200	0,2	200	0,1
Intesa Sanpaolo Bank Ireland.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Italcementi Finance.....	—	—	—	—	—	—	750	0,4
IVS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Jefferies Group Inc.....	—	—	—	—	—	—	—	—
JP Morgan Chase & Co.....	—	—	—	—	—	—	—	—
K & S.....	—	—	—	—	750	0,7	750	0,4
KBC Ifima.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Kering.....	—	—	—	—	—	—	—	—
KfW - Kreditanstalt fuer Wiederaufbau.....	50	0,3	50	0,3	50	*	8.050	4,1

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Danone Groupe.....	500	0,2	500	0,2	500	0,2	500	0,2	2.000	0,4	2.000	0,3
Danske Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2	750	0,1
Deutsche Bahn Finance.....	1.000	0,4	1.000	0,4	1.500	0,5	1.500	0,5	2.150	0,5	7.200	1,0
Deutsche Bank.....	1.043	0,4	1.043	0,4	1.043	0,4	—	—	—	—	3.250	0,5
Deutsche Boerse.....	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	1.700	0,2
Deutsche Lufthansa.....	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1	500	0,1
Deutsche Post..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	1.000	0,4	1.000	0,2	4.500	0,7
Deutsche Postbank.....	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,3	1.000	0,2	1.000	0,1
Deutsche Telekom International Finance.....	5.750	2,2	5.750	2,1	7.750	2,7	7.000	2,2	7.750	1,7	13.700	2,0
Diageo Finance.....	—	—	—	—	—	—	850	0,3	850	0,2	850	0,1
Dresdner Bank..... ²⁾	200	0,1	200	0,1	—	—	—	—	—	—	—	—
DS Smith.....	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
DVB Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—	1.500	0,3	1.500	0,2
E.On International Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4.069	0,6
EDF - Electricité de France.....	2.500	1,0	2.500	0,9	3.900	1,4	3.900	1,2	3.900	0,8	7.250	1,0
EDP Finance.....	750	0,3	750	0,3	1.350	0,5	2.350	0,7	2.350	0,5	4.100	0,6
Enagas Financiaciones.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,1
EnBW International Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
ENEL Finance International..... ³⁾	8.300	3,2	11.300	4,2	11.300	4,0	11.300	3,5	11.513	2,5	11.270	1,6
Engie..... ^{4) 5)}	2.000	0,8	2.000	0,7	2.000	0,7	4.500	1,4	7.000	1,5	9.312	1,3
Eurogrid.....	—	—	—	—	—	—	—	—	750	0,2	750	0,1
Eutelsat.....	850	0,3	850	0,3	850	0,3	850	0,3	850	0,2	850	0,1
FCA Capital Ireland..... ⁶⁾	—	—	—	—	—	—	750	0,2	2.250	0,5	3.250	0,5
FCE Bank.....	—	—	—	—	—	—	—	—	1.950	0,4	2.550	0,4
Fe New.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
Fiat Chrysler Automobiles.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.250	0,2
Fiat Chrysler Finance Europe..... ⁷⁾	9.700	3,8	9.900	3,7	12.000	4,2	13.400	4,2	10.900	2,3	9.800	1,4
Finmeccanica Finance.....	2.300	0,9	2.900	1,1	2.600	0,9	2.600	0,8	2.600	0,6	—	—
General Electric Capital Corporation..... ⁸⁾	18.650	7,3	16.750	6,3	18.000	6,3	12.900	4,0	16.850	3,6	13.750	2,0
GIE PSA Trésorerie.....	600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,1	600	0,1
GlaxoSmithKline Capital.....	—	—	—	—	—	—	2.500	0,8	2.500	0,5	2.500	0,4
Glencore Finance Europe.....	—	—	—	—	750	0,3	1.450	0,4	4.550	1,0	5.550	0,8
Goldman Sachs Group..... ⁹⁾	2.080	0,8	2.080	0,8	1.306	0,5	3.556	1,1	11.400	2,4	18.025	2,6
Heineken.....	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
HSBC Bank..... ¹⁰⁾	2.750	1,1	2.750	1,0	2.750	1,0	3.750	1,2	5.250	1,1	9.250	1,3
Iberdrola..... ¹¹⁾	2.750	1,1	2.750	1,0	2.750	1,0	2.500	0,8	3.600	0,8	7.400	1,1
IBM - International Business Machine Corporation.....	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
Infineon Technologies.....	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
ING Bank.....	1.250	0,5	1.250	0,5	1.250	0,4	1.250	0,4	1.500	0,3	2.000	0,3
Instituto de Credito Oficial.....	200	0,1	200	0,1	200	0,1	300	0,1	—	—	18.610	2,7
Intesa Sanpaolo Bank Ireland.....	—	—	—	—	1.500	0,6	—	—	—	—	—	—
Italcementi Finance.....	750	0,3	750	0,3	1.100	0,4	1.100	0,3	1.100	0,2	1.100	0,2
IVS Group.....	—	—	—	—	—	—	—	—	240	0,1	240	*
Jefferies Group Inc.....	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1	500	0,1
JP Morgan Chase & Co.....	—	—	—	—	—	—	4.000	1,2	9.000	1,9	10.500	1,5
K & S.....	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	1.000	0,1
Kering.....	—	—	—	—	—	—	500	0,2	1.000	0,2	1.500	0,2
KfW - Kreditanstalt fuer Wiederaufbau.....	18.050	7,0	23.050	8,6	23.050	8,1	20.050	6,2	18.050	3,9	13.550	2,0

1) Gli importi indicati includono quelli relativi a Deutsche Post (1.000 nel 2013, nel 2014, nel 2015 e 3.250 nel 2016) e Deutsche Post Finance (1.250 nel 2016). - 2) Gruppo Commerzbank. - 3) 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, 11.213 nel 2015 e 10.970 nel 2016) ed Enel Investment Holding (300 nel 2009, nel 2010, nel 2011, nel 2012, nel 2013, nel 2014, nel 2015 e nel 2016). - 4) Già GDF Suez. - 5) Gli importi indicati includono quelli relativi a Groupement d'intérêt économique Suez Alliance (650 nel 2009) e GDF Suez (1.000 nel 2010). - 6) Già FGA Capital Ireland. - 7) 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, 7.000 nel 2015 e 5.400 nel 2016). - 8) CNH Industrial Finance Europe, già Fiat Industrial Finance Europe (2.200 nel 2011, nel 2012 e nel 2013, 3.900 nel 2014, 2.900 nel 2015 e 3.400 nel 2016) e Fiat Chrysler Finance North America, già Fiat Finance North America (1.000 nel

2011, nel 2012, nel 2013, nel 2014, nel 2015 e nel 2016). - 9) 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, 16.850 nel 2015 e 13.750 nel 2016) e GE Capital UK Funding (2.000 nel 2009, nel 2010, nel 2011, nel 2012 e nel 2013). - 10) 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, 10.350 nel 2015 e 16.850 nel 2016), Goldman Sachs International (50 nel 2015 e 175 nel 2016) e Goldman Sachs & Co. (1.000 nel 2015 e nel 2016). - 11) Gli importi indicati includono quelli relativi a HSBC Bank (1.250 nel 2009, 2.750 nel 2010, nel 2011, nel 2012 e nel 2013, 3.750 nel 2014 e nel 2015 e 2.500 nel 2016) e HSBC Holdings (1.500 nel 2015 e 6.750 nel 2016). - 12) Gli importi indicati includono quelli relativi a Iberdrola Finanzas (1.250 nel 2010, 2.750 nel 2011, 2012 e 2013, 2.000 nel 2014 e nel 2015 e 1.250 nel 2016) e Iberdrola International (500 nel 2014, 1.600 nel 2015 e 6.150 nel 2016).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO

LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI

AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Koninklijke DSM	—	—	—	—	—	—	—	—
Koninklijke KPN	—	—	—	—	2.425	2,3	3.425	1,7
Lafarge	—	—	—	—	—	—	1.000	0,5
Lanxess	—	—	—	—	—	—	—	—
Leeds Building Society	—	—	—	—	—	—	—	—
Lehman Brothers Treasury	113	0,7	113	0,7	113	0,1	13	*
Linde ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—
Lloyds Bank ²⁾	—	—	—	—	5.000	4,8	6.500	3,3
LVMH - Louis Vuitton Moët Hennessy	—	—	—	—	600	0,6	600	0,3
Macquarie Structured Securities (Europe)	—	—	—	—	—	—	—	—
Man	—	—	—	—	—	—	—	—
McDonald's Corporation	—	—	—	—	—	—	—	—
Merck Financial Services	—	—	—	—	—	—	—	—
Merrill Lynch ³⁾	1.901	12,4	3.312	19,1	4.883	4,7	4.832	2,4
Metro	—	—	—	—	600	0,6	1.350	0,7
Morgan Stanley	1.530	10,0	4.025	23,2	3.923	3,8	5.243	2,6
National Australia Bank	—	—	—	—	—	—	1.250	0,6
Nationwide Building Society	—	—	—	—	—	—	—	—
Nestlé Finance International	—	—	—	—	—	—	—	—
Nomura Europe Finance	—	—	—	—	1.000	1,0	1.000	0,5
Nordea Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
NV Bank Nederlandse Gemeenten	—	—	—	—	—	—	—	—
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs	—	—	—	—	—	—	—	—
Orange ⁴⁾	—	—	—	—	2.150	2,1	2.250	1,1
OTE	—	—	—	—	—	—	—	—
Pernod Ricard	—	—	—	—	—	—	1.200	0,6
Petrobras Global Finance	—	—	—	—	—	—	—	—
Petroleos Mexicanos	—	—	—	—	—	—	—	—
Peugeot	—	—	—	—	750	0,7	1.750	0,9
Pohjola Bank	—	—	—	—	—	—	—	—
Portugal Telecom International Finance	—	—	—	—	750	0,7	750	0,4
Rabobank Nederland	—	—	—	—	—	—	12.500	6,3
Renault ⁵⁾	—	—	—	—	2.000	1,9	4.775	2,4
Repsol International Finance	—	—	—	—	1.000	1,0	1.000	0,5
Rheinmetall	—	—	—	—	—	—	500	0,3
Roche Finance Europe	—	—	—	—	—	—	—	—
Royal Bank of Canada	—	—	—	—	—	—	—	—
RTE - Réseau de transport d'électricité	—	—	—	—	—	—	—	—
RWE Finance	—	—	—	—	1.500	1,4	1.500	0,8
Ryanair	—	—	—	—	—	—	—	—
Saipem Finance International	—	—	—	—	—	—	—	—
Sanofi Aventis	—	—	—	—	1.500	1,4	1.500	0,8
Santander ⁶⁾	—	—	—	—	—	—	1.000	0,5
SAP	—	—	—	—	—	—	1.000	0,5
Schneider Electric	—	—	—	—	—	—	—	—
SFEF - Société de financement de l'économie française	—	—	—	—	5.000	4,8	5.000	2,5
Shell International Finance	—	—	—	—	—	—	—	—
Siemens Financieringsmaatschappij	—	—	—	—	—	—	—	—
Sixt	—	—	—	—	—	—	—	—

1) Gli importi indicati includono quelli relativi a Linde Aktiengesellschaft (1.650 nel 2016) e Linde Finance (800 nel 2016). - 2) Già Lloyds TSB Bank. - 3) Gruppo Bank of America. - 4) Già France Télécom. - 5) 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, 6.050 nel 2015 e 8.050 nel 2016) 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, 2.100 nel

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Koninklijke DSM	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2	1.000	0,1
Koninklijke KPN	2.000	0,8	2.000	0,7	2.000	0,7	2.000	0,6	1.000	0,2	1.000	0,1
Lafarge	1.000	0,4	1.000	0,4	1.750	0,6	1.750	0,5	1.750	0,4	1.750	0,3
Lanxess	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1
Leeds Building Society	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1
Lehman Brothers Treasury	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	13	*
Linde ¹⁾	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.450	0,4
Lloyds Bank ²⁾	6.500	2,5	6.500	2,4	7.500	2,6	10.000	3,1	14.000	3,0	12.000	1,7
LVMH - Louis Vuitton Moët Hennessy	—	—	—	—	600	0,2	1.250	0,4	1.250	0,3	1.750	0,3
Macquarie Structured Securities (Europe)	95	*	95	*	95	*	95	*	95	*	75	*
Man	—	—	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2	750	0,1
McDonald's Corporation	—	—	—	—	350	0,1	850	0,3	2.250	0,5	5.350	0,8
Merck Financial Services	—	—	—	—	—	—	—	—	2.050	0,4	3.400	0,5
Merrill Lynch ³⁾	6.120	2,4	5.371	2,0	2.225	0,8	25	*	25	*	—	—
Metro	1.350	0,5	1.850	0,7	1.850	0,6	1.750	0,5	2.350	0,5	2.350	0,3
Morgan Stanley	4.818	1,9	3.628	1,4	1.513	0,5	1.513	0,5	1.513	0,3	4.500	0,7
National Australia Bank	1.250	0,5	1.250	0,5	1.250	0,4	1.250	0,4	2.250	0,5	5.000	0,7
Nationwide Building Society	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2	1.000	0,1
Nestlé Finance International	—	—	—	—	500	0,2	500	0,2	1.000	0,2	1.500	0,2
Nomura Europe Finance	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	4.250	0,6
NV Bank Nederlandse Gemeenten	—	—	—	—	—	—	—	—	3.400	0,7	8.150	1,2
O2 Telefonica Deutschland Finanzierungs	—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1	1.100	0,2
Orange ⁴⁾	5.480	2,1	4.730	1,8	6.230	2,2	6.230	1,9	5.080	1,1	10.130	1,5
OTE	1.250	0,5	1.250	0,5	—	—	—	—	—	—	—	—
Pernod Ricard	1.200	0,5	1.200	0,4	1.200	0,4	1.850	0,6	2.350	0,5	1.750	0,3
Petrobras Global Finance	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	4.150	0,6
Petroleos Mexicanos	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,1
Peugeot	2.250	0,9	2.850	1,1	4.450	1,6	3.700	1,1	3.200	0,7	2.700	0,4
Pohjola Bank	—	—	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2	1.250	0,2
Portugal Telecom International Finance	750	0,3	750	0,3	750	0,3	750	0,2	2.132	0,5	2.132	0,3
Rabobank Nederland	16.000	6,2	16.000	6,0	16.000	5,6	9.500	2,9	9.000	1,9	16.250	2,3
Renault ⁵⁾	5.375	2,1	5.525	2,1	4.950	1,7	6.400	2,0	8.150	1,7	10.500	1,5
Repsol International Finance	3.636	1,4	2.886	1,1	2.886	1,0	1.886	0,6	2.486	0,5	4.186	0,6
Rheinmetall	500	0,2	500	0,2	500	0,2	500	0,2	500	0,1	500	0,1
Roche Finance Europe	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2	1.650	0,2
Royal Bank of Canada	—	—	—	—	—	—	—	—	1.250	0,3	1.250	0,2
RTE - Réseau de transport d'électricité	—	—	—	—	—	—	500	0,2	1.500	0,3	2.850	0,4
RWE Finance	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,2	5.130	0,7
Ryanair	—	—	—	—	—	—	850	0,3	1.700	0,4	1.700	0,2
Saipem Finance International	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.000	0,1
Sanofi Aventis	1.500	0,6	1.500	0,6	3.500	1,2	5.050	1,6	5.050	1,1	6.350	0,9
Santander ⁶⁾	1.000	0,4	1.000	0,4	—	—	—	—	5.500	1,2	9.250	1,3
SAP	1.000	0,4	1.000	0,4	1.000	0,4	500	0,2	2.100	0,5	2.850	0,4
Schneider Electric	—	—	—	—	—	—	—	—	1.550	0,3	1.550	0,2
SFEF - Société de financement de l'économie française	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	13.200	1,9
Siemens Financieringsmaatschappij	—	—	—	—	—	—	—	—	1.250	0,3	6.850	1,0
Sixt	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1

2015 e 2.450 nel 2016). - 6) Gli importi indicati includono quelli relativi a Santander International Debt (1.000 nel 2010, nel 2011 e nel 2012, 1.250 nel 2015 e nel 2016), Santander Consumer Bank (750 nel 2015 e 1.250 nel 2016), Santander Consumer Finance (2.000 nel 2015 e 3.750 nel 2016) e Santander Issuances (1.500 nel 2015 e 3.000 nel 2016).

AMMONTARE DEI TITOLI DI STATO

LISTED GOVERNMENT SECURITIES

E DELLE OBBLIGAZIONI QUOTATI

AND BONDS IN ISSUE

(milioni di euro)

TITOLI	31-XII-2007		31-XII-2008		31-XII-2009		31-XII-2010	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
Skandinaviska Enskilda Banken	—	—	—	—	—	—	—	—
Société Générale..... ¹⁾	—	—	—	—	—	—	246	0,1
Sodexo	—	—	—	—	—	—	—	—
Statkraft	—	—	—	—	—	—	—	—
Statoil Asa.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Suez Environment Company.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Swedbank.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Telecom Italia Finance	—	—	—	—	1.865	1,8	1.865	0,9
Telefonica Emisiones	—	—	—	—	3.750	3,6	5.150	2,6
Telekom Finanzmanagement.....	—	—	—	—	1.250	1,2	1.250	0,6
Teliasonera	—	—	—	—	—	—	500	0,3
Tesco	—	—	—	—	750	0,7	—	—
Teva Pharmaceutical Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Thales	—	—	—	—	—	—	600	0,3
The Royal Bank of Scotland..... ²⁾	—	—	—	—	2.000	1,9	8.778	4,4
Thyssenkrupp.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Total Capital..... ³⁾	—	—	—	—	550	0,5	1.050	0,5
Toyota Motor Credit Corporation.....	—	—	—	—	—	—	2.500	1,3
UBS..... ⁴⁾	—	—	—	—	—	—	100	0,1
Unilever	—	—	—	—	—	—	—	—
Urenco Finance.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Veolia Environment	—	—	—	—	900	0,9	900	0,5
Verbund International Finance.....	—	—	—	—	840	0,8	840	0,4
Vivendi.....	—	—	—	—	1.200	1,2	1.950	1,0
Vodafone Group.....	—	—	—	—	—	—	1.250	0,6
Volkswagen Bank	—	—	—	—	1.250	1,2	4.750	2,4
Wells Fargo & Company.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Wurth Finance International.....	—	—	—	—	—	—	—	—
Totale	15.373	100,0	17.323	100,0	103.587	100,0	198.392	100,0
<i>% sul totale generale</i>		<i>0,6</i>		<i>0,6</i>		<i>3,3</i>		<i>5,8</i>
<i>di cui:</i>								
<i>Assicurative e bancarie</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>86.964</i>	<i>43,8</i>
<i>Industriali</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>	<i>111.428</i>	<i>56,2</i>
Totale generale	2.420.226	100,0	2.684.279	100,0	3.142.087	100,0	3.418.771	100,0

TITOLI	31-XII-2011		31-XII-2012		31-XII-2013		31-XII-2014		31-XII-2015		31-XII-2016	
	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%	Importo in circolazione	%
—	—	—	—	—	—	—	—	—	600	0,1	1.600	0,2
2.557	1,0	2.557	1,0	557	0,2	526	0,2	2.801	0,6	4.060	0,6	
—	—	—	—	—	—	1.100	0,3	1.100	0,2	1.100	0,2	
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1	
—	—	—	—	—	—	—	—	2.250	0,5	2.250	0,3	
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1	
—	—	—	—	—	—	—	—	2.000	0,4	2.000	0,3	
1.865	0,7	1.865	0,7	1.015	0,4	1.015	0,3	1.015	0,2	1.015	0,1	
6.350	2,5	8.550	3,2	18.102	6,3	16.652	5,2	16.252	3,5	18.700	2,7	
1.250	0,5	1.250	0,5	500	0,2	500	0,2	1.250	0,3	1.250	0,2	
1.750	0,7	1.750	0,7	1.750	0,6	1.750	0,5	1.750	0,4	1.750	0,3	
—	—	—	—	—	—	2.000	0,6	2.000	0,4	2.000	0,3	
—	—	—	—	—	—	—	—	2.000	0,4	2.000	0,3	
600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,2	600	0,1	—	—	
10.461	4,1	10.486	3,9	10.493	3,7	9.402	2,9	7.990	1,7	7.851	1,1	
—	—	1.250	0,5	1.250	0,4	2.500	0,8	3.850	0,8	6.200	0,9	
1.050	0,4	1.050	0,4	1.050	0,4	3.550	1,1	3.850	0,8	7.450	1,1	
2.500	1,0	—	—	—	—	1.000	0,3	4.250	0,9	4.250	0,6	
160	0,1	130	*	130	*	3.130	1,0	8.380	1,8	6.865	1,0	
750	0,3	750	0,3	750	0,3	750	0,2	750	0,2	1.950	0,3	
—	—	—	—	—	—	500	0,2	500	0,1	500	0,1	
900	0,4	900	0,3	900	0,3	900	0,3	1.400	0,3	500	0,1	
840	0,3	840	0,3	840	0,3	840	0,3	840	0,2	840	0,1	
1.950	0,8	1.950	0,7	2.700	0,9	2.700	0,8	2.700	0,6	2.200	0,3	
1.250	0,5	1.250	0,5	1.250	0,4	2.250	0,7	3.500	0,8	11.250	1,6	
7.000	2,7	8.550	3,2	8.500	3,0	9.700	3,0	19.300	4,1	18.200	2,6	
—	—	—	—	—	—	1.000	0,3	5.000	1,1	5.000	0,7	
—	—	—	—	—	—	—	—	500	0,1	500	0,1	
256.550	100,0	267.895	100,0	285.284	100,0	322.274	100,0	466.580	100,0	691.755	100,0	
	<i>6,9</i>		<i>6,9</i>		<i>6,9</i>		<i>6,4</i>		<i>8,9</i>		<i>12,6</i>	
<i>115.459</i>	<i>45,0</i>	<i>123.654</i>	<i>46,2</i>	<i>112.616</i>	<i>39,5</i>	<i>127.206</i>	<i>39,5</i>	<i>196.577</i>	<i>42,1</i>	<i>288.102</i>	<i>41,6</i>	
<i>141.091</i>	<i>55,0</i>	<i>144.241</i>	<i>53,8</i>	<i>172.668</i>	<i>60,5</i>	<i>195.068</i>	<i>60,5</i>	<i>270.003</i>	<i>57,9</i>	<i>403.653</i>	<i>58,4</i>	
3.693.760	100,0	3.868.702	100,0	4.156.873	100,0	4.864.385	100,0	5.135.642	100,0	5.407.866	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, 3.000 nel 2014 e nel 2015 e 4.500 nel 2016), 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, 1.879 nel 2015 e 276 nel 2016) 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, 3.111 nel 2015 e 3.075 nel 2016). - 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 e nel 2016), Total Capital Canada (2.500 nel 2014, nel 2015 e nel 2016) e Total Capital International (850 nel 2015 e 4.450 nel 2016). - 4) Gli importi indicati includono quelli relativi ad UBS (30 nel 2010 e nel 2011,

3.750 nel 2015 e nel 2016), UBS Filiale del Regno Unito (60 nel 2011, nel 2012 e nel 2013, 3.060 nel 2014, 4.560 nel 2015 e 2.045 nel 2016) ed UBS Filiale di Saint Helier (70 nel 2010, nel 2011, nel 2012, nel 2013, nel 2014, nel 2015 e nel 2016). - 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, 1.850 nel 2015 e 1.250 nel 2016), Volkswagen Financial Service (1.000 nel 2010, nel 2011, nel 2012 e nel 2013 e 1.250 nel 2015 e nel 2016), 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, 11.200 nel 2015 e 9.700 nel 2016) e Volkswagen Leasing GmbH (3.250 nel 2011, 2.050 nel 2012, 2.000 nel 2013, 3.250 nel 2014, 5.000 nel 2015 e 6.000 nel 2016).

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 2017

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2017

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 2017

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2017

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	7,677	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 2017

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2017

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 2017

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2017

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	6,354	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 2017

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2017

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

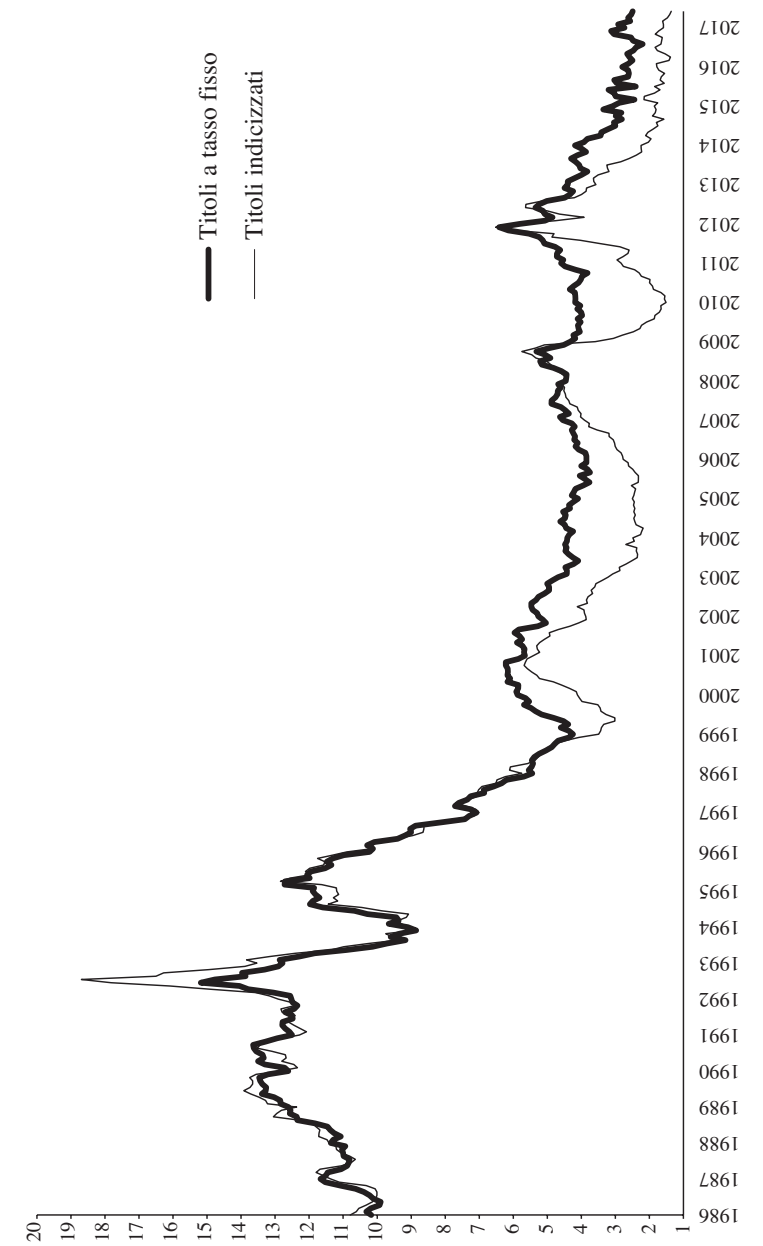
AVERAGE REDEMPTION YIELD ON SELECTED ITALIAN GOVERNMENT SECURITIES

DI TITOLI DI STATO E OBBLIGAZIONI:
1986 AL GIUGNO 2017

AND BONDS: MONTHLY AVERAGES FROM OCTOBER 1986 TO JUNE 2017

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
Luglio	2,388	3,245	1,684	2,237	1,831	2,018	1,688	2,514
Agosto	2,197	2,066	1,570	2,208	1,660	2,055	1,271	2,768
Settembre	2,483	1,919	1,691	2,564	1,642	2,062	1,239	2,786
Ottobre	2,539	1,651	1,645	2,760	1,622	1,914	1,260	2,814
Novembre	3,039	2,394	2,259	3,160	1,827	2,151	1,408	2,855
Dicembre	3,126	3,924	1,980	3,143	1,727	1,973	1,398	2,732
2017								
Gennaio	2,731	1,103	1,583	3,206	1,590	1,339	1,677	2,063
Febbraio	2,918	1,479	1,877	3,214	1,588	1,745	1,602	2,085
Marzo	2,563	1,098	1,659	3,090	1,612	1,787	1,410	2,575
Aprile	2,626	1,117	2,140	3,104	1,471	1,556	1,229	2,631
Maggio	2,534	0,855	1,939	3,047	1,406	1,311	1,264	2,496
Giugno	2,489	1,300	1,687	2,845	1,358	1,221	1,187	2,364

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)			
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>Variatz. 07/06</i>	<i>-0,27</i>	<i>0,80</i>	<i>0,02</i>	<i>Variatz. 09/08</i>	<i>-2,59</i>	<i>-2,63</i>	<i>-0,10</i>
2008				2010			
Gennaio	2,88	3,95	3,16	Gennaio	1,34	0,80	2,85
Febbraio	2,87	3,41	3,21	Febbraio	1,26	0,97	2,89
Marzo	3,26	3,79	3,18	Marzo	1,49	0,90	2,80
Aprile	3,33	3,95	3,18	Aprile	1,63	0,93	2,80
Maggio	3,55	4,03	3,17	Maggio	1,48	1,44	2,77
Giugno	3,77	4,58	3,20	Giugno	1,33	1,38	2,80
Luglio	3,99	4,53	3,20	Luglio	1,70	1,40	2,81
Agosto	3,91	4,30	3,22	Agosto	1,55	1,37	2,80
Settembre	3,68	4,31	3,24	Settembre	1,55	1,43	2,81
Ottobre	3,36	3,06	3,22	Ottobre	1,70	1,44	2,78
Novembre	2,59	2,64	3,25	Novembre	1,70	1,78	2,80
Dicembre	2,05	2,63	3,20	Dicembre	1,91	2,01	2,78
<i>Media</i>	<i>3,27</i>	<i>3,76</i>	<i>3,20</i>	<i>Media</i>	<i>1,55</i>	<i>1,32</i>	<i>2,81</i>
<i>Variatz. 08/07</i>	<i>1,56</i>	<i>-0,32</i>	<i>0,06</i>	<i>Variatz. 10/09</i>	<i>0,87</i>	<i>0,18</i>	<i>-0,29</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.

DEI BUONI ORDINARI DEL TESORO E IL RENDIMENTO
BANCHE, DAL GENNAIO 2007 AL GIUGNO 2017
AND BANK BOND YIELD FROM JANUARY 2007 TO JUNE 2017

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)			
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>Variatz. 11/10</i>	<i>1,30</i>	<i>1,90</i>	<i>0,02</i>	<i>Variatz. 13/12</i>	<i>-1,74</i>	<i>-1,35</i>	<i>-0,14</i>
2012				2014			
Gennaio	3,16	2,74	2,85	Gennaio	0,56	0,74	2,60
Febbraio	3,25	2,23	2,87	Febbraio	0,47	0,68	2,63
Marzo	3,24	1,41	2,87	Marzo	0,28	0,59	2,58
Aprile	3,22	2,84	2,88	Aprile	0,47	0,59	2,57
Maggio	3,02	2,34	2,86	Maggio	0,37	0,65	2,53
Giugno	3,12	3,97	2,87	Giugno	0,28	0,50	2,52
Luglio	2,92	2,70	2,84	Luglio	0,09	0,39	2,48
Agosto	3,00	2,77	2,83	Agosto	-0,09	0,28	2,47
Settembre	3,10	1,69	2,85	Settembre	-0,09	0,27	2,47
Ottobre	2,50	1,94	2,79	Ottobre	0,09	0,30	2,43
Novembre	2,21	1,76	2,80	Novembre	0,19	0,34	2,43
Dicembre	2,21	1,46	2,78	Dicembre	-0,09	0,42	2,40
<i>Media</i>	<i>2,91</i>	<i>2,32</i>	<i>2,84</i>	<i>Media</i>	<i>0,21</i>	<i>0,48</i>	<i>2,51</i>
<i>Variatz. 12/11</i>	<i>0,06</i>	<i>-0,90</i>	<i>0,01</i>	<i>Variatz. 14/13</i>	<i>-0,97</i>	<i>-0,50</i>	<i>-0,20</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 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)				
2015				2017			
Gennaio	-0,75	0,24	2,37	Gennaio	0,90	-0,25	1,97
Febbraio	-0,37	0,21	2,42	Febbraio	1,51	-0,25	2,00
Marzo	-0,19	0,08	2,36	Marzo	1,41	-0,23	1,95
Aprile	-0,28	0,03	2,35	Aprile	1,71	-0,24	1,95
Maggio	-0,09	0,06	2,32	Maggio	1,40	-0,30	1,92
Giugno	-0,09	0,06	2,32	Giugno	1,10	-0,35	1,92
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>	<i>-0,17</i>	<i>0,07</i>	<i>2,30</i>				
<i>Variaz. 15/14</i>	<i>-0,38</i>	<i>-0,41</i>	<i>-0,21</i>				
2016							
Gennaio	0,26	-0,07	2,17				
Febbraio	-0,22	0,03	2,18				
Marzo	-0,31	0,07	2,13				
Aprile	-0,40	-0,08	2,13				
Maggio	-0,39	-0,14	2,09				
Giugno	-0,29	-0,12	2,09				
Luglio	0,11	-0,18	2,06				
Agosto	-0,28	-0,19	2,05				
Settembre	0,09	-0,18	2,05				
Ottobre	-0,09	-0,24	2,02				
Novembre	0,39	-0,22	2,02				
Dicembre	-0,01	-0,20	1,99				
<i>Media</i>	<i>-0,09</i>	<i>-0,13</i>	<i>2,13</i>				
<i>Variaz. 16/15</i>	<i>-0,09</i>	<i>-0,13</i>	<i>2,13</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 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 2007 AL GIUGNO 2017
AND BANK BOND YIELD FROM JANUARY 2007 TO JUNE 2017

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): 2007-2017

