

DEBITO ESTERO PRIMA DELLE OPERAZIONI DI SWAP
(situazione al 31 dicembre 2009)

Tipo tasso	Codice ISIN	Data di emissione	Data di scadenza	Importo (milioni)	Cedola
USD					
GLOBAL t. fisso	US465410AH18	27-set-93	27-set-23	3.500	6,875%
EUROBOND t. fisso	IT0000367539	05-mar-96	05-mar-10	750	5,81%
EUROBOND t. fisso	IT0000367547	05-mar-96	05-mar-12	1.500	6,025%
EUROBOND t. fisso	IT0000367869	20-dic-96	20-dic-12	1.500	5,97%
GLOBAL t. fisso	XS0125141316	22-feb-01	22-feb-11	2.000	6,00%
GLOBAL t. fisso	XS0144129649	01-mar-02	15-giu-12	3.000	5,625%
GLOBAL t. fisso	US465410BF43	27-feb-03	15-giu-13	2.000	4,375%
GLOBAL t. fisso	US465410BG26	27-feb-03	15-giu-33	2.000	5,375%
E.M.T.N. t. fisso	XS0180021759	14-nov-03	15-nov-10	100	4,17%
E.M.T.N. t. fisso	XS0181635516	09-dic-03	09-dic-10	100	4,06%
GLOBAL t. fisso	US465410BN76	21-gen-05	21-gen-15	4.000	4,50%
GLOBAL t. fisso	US465410BQ08	25-gen-06	25-gen-16	2.000	4,75%
GLOBAL t. fisso	US465410BR80	20-set-06	20-set-16	3.000	5,25%
GLOBAL t. fisso	US465410BS63	12-giu-07	12-giu-17	2.000	5,38%
GLOBAL t. fisso	US465410BT47	04-giu-08	15-lug-11	2.500	3,50%
GLOBAL t. fisso	US465410BU10	05-ott-09	05-ott-12	2.500	2,13%
Totale USD				32.450	
EURO					
EUROBOND t. fisso	XS0030553530	07-mar-91	07-mar-11	2.500	9,25%
EUROBOND t. variabile	IT0000367455	11-dic-95	20-dic-10	1.023	libor 3m - 0,0625%
EUROBOND t. fisso	NL0000121739	29-mag-97	29-mag-12	567	6,125%
E.M.T.N. t. variabile	XS0091247642	08-ott-98	08-ott-18	60	libor 3m -16 b.p.
E.M.T.N. t. variabile	XS0091349489	15-ott-98	15-ott-18	300	((1+86%*TEC10)^0,25)-1; Floor:3% su 86%*TEC10
E.M.T.N. t. variabile	XS0096856421	06-mag-99	06-mag-19	1.000	4,00%
E.M.T.N. t. variabile	XS0098449456	28-giu-99	28-giu-29	905	80%CMS 30Y; Floor 4,25%
E.M.T.N. t. variabile	XS0100688190	30-ago-99	30-ago-19	1.000	CMS30Y - 0,91%; Floor:0%
E.M.T.N. t. fisso	XS0124812503	20-feb-01	19-feb-31	150	0 coupon
E.M.T.N. t. fisso	XS0133144898	25-lug-01	25-lug-16	3.000	5,750%
E.M.T.N. t. variabile	XS0141757921	22-gen-02	22-gen-12	400	3m€-0,06%
E.M.T.N. t. variabile	XS0191331411	26-apr-04	26-apr-19	150	84,5% cms 10Y
⁽¹⁾ E.M.T.N. t. variabile	XS0218274107	31-mag-05	31-mag-35	300	CMS10Y
EUROBOND t. fisso	IT0003887392	02-giu-05	02-giu-29	720	3,83%
⁽²⁾ EUROBOND t. fisso (fino al 2010)	IT0003887384	02-giu-05	02-giu-30	395	3,523%
E.M.T.N. t. variabile	XS0220252521	08-giu-05	08-giu-20	200	85% *CMS10Y; cap 7,45%
E.M.T.N. t. variabile	XS0222189564	15-giu-05	15-giu-20	2.500	85% *CMS 10Y; floor:2%; cap:7%
E.M.T.N. t. variabile	XS0222737529	28-giu-05	28-giu-21	300	85,5% * CMS 10Y; floor:2%; cap:7%
E.M.T.N. t. variabile	XS0233944056	09-nov-05	09-nov-25	200	Max {0, Min [10*(CMS10 - CMS2), 6mEuribor + 1,50%]}
E.M.T.N. t. variabile	XS0244425194	17-mar-06	17-mar-21	900	6m Euribor + 0,04%
E.M.T.N. t. variabile	XS0247770224	22-mar-06	22-mar-18	1.000	6m Euribor + 0,60%
E.M.T.N. t. fisso	XS0247541971	28-mar-06	28-mar-36	192	capitalizzazione integrale
E.M.T.N. t. variabile	XS0247594079	30-mar-06	29-mar-26	300	6m Euribor + 0,075%
E.M.T.N. t. variabile	XS0253994809	11-mag-06	11-mag-26	215	5,07% / 10y cms
E.M.T.N. indicizzato	XS0280146357	05-gen-07	15-set-57	1.056	1,85% indicizzato all'inflazione Europea
E.M.T.N. indicizzato	XS0293217799	30-mar-07	15-set-62	264	2,00% indicizzato all'inflazione Europea
EUROBOND t. fisso	IT0004235559	05-apr-07	05-apr-27	160	4,49%
E.M.T.N. indicizzato	XS0342993747	23-gen-08	15-set-58	519	2,20% indicizzato all'inflazione Europea
EUROBOND t. fisso	ITSSD1603026	16-mar-09	16-mar-26	258	5,26%
E.M.T.N. t. fisso	XS0431307221	29-mag-09	29-nov-13	300	3,00%
Totale EURO				20.834	
PRESTITI Ispa in EURO ⁽³⁾					
E.M.T.N. t. fisso	IT0003621445	06-feb-04	31-lug-14	1.000	4,50%
E.M.T.N. indicizzato	IT0003621452	06-feb-04	31-lug-19	834	2,25% cedola reale
E.M.T.N. t. fisso	IT0003621460	06-feb-04	31-lug-24	3.250	5,13%
E.M.T.N. t. fisso	IT0003685093	06-feb-04	31-lug-34	2.200	5,20%
E.M.T.N. t. variabile	IT0003805295	04-mar-05	31-lug-45	850	Euribor 12 M + spread 0,23% (con amm.)
E.M.T.N. t. variabile	IT0003838031	25-apr-05	31-lug-45	1.000	Euribor 12 M + spread 0,235% (con amm.)
E.M.T.N. t. variabile	IT0003874523	30-giu-05	31-lug-35	300	3,5% (con cap fino al 6,0%)
E.M.T.N. t. variabile	IT0003877310	30-giu-05	31-lug-35	100	3,5% (con cap fino al 6,1%)
Totale prestiti Ispa in EURO				9.534	

(1) Cap 6%; 12mEuribor+0,10% dal 31 maggio 2005 al 31 maggio 2007; CMS 10Y dal 2007 al 2035.

(2) Successivamente il titolo paga un tasso variabile determinato con la seguente formula: 3,523% + 3 * Min [Max (3,50% - tasso swap 20Y; 0,0%); 1,50%]

(3) Debito contratto da Infrastrutture S.p.A.

DEBITO ESTERO PRIMA DELLE OPERAZIONI DI SWAP
(situazione al 31 dicembre 2009)

Tipo tasso	Codice ISIN	Data di emissione	Data di scadenza	Importo (milioni)	Cedola
JPY					
EUROBOND t. fisso	XS0054324560	15-dic-94	15-dic-14	125.000	5,50%
EUROBOND t. fisso	XS0057935214	08-giu-95	08-giu-15	125.000	4,50%
EUROBOND t. fisso	XS0070731194	14-nov-96	14-nov-16	100.000	3,70%
EUROBOND t. fisso	XS0074525949	24-mar-97	24-mar-17	100.000	3,45%
GLOBAL t. fisso	XS0108238543	23-feb-00	23-feb-10	100.000	1,80%
E.M.T.N. t. fisso	XS0253520927	18-mag-06	18-mag-36	25.000	2,87%
E.M.T.N. t. variabile	XS0359299590	24-apr-08	24-apr-18	50.000	3mJpy libor +12b.p.%
E.M.T.N. t. variabile	XS0436313901	08-lug-09	08-lug-19	30.000	3m Jpy libor +40 bp%
E.M.T.N. t. variabile	XS0450792790	18-set-09	18-set-19	30.000	3m Jpy libor +37 bp%
Totale JPY				685.000	
CHF					
E.M.T.N. t. fisso	CH0009818706	15-gen-99	15-lug-10	1.500	3,13%
E.M.T.N. t. fisso	CH0018759909	01-lug-04	01-lug-11	1.000	2,75%
E.M.T.N. t. fisso	CH0020386485	02-feb-05	02-mar-15	2.000	2,50%
E.M.T.N. t. fisso	CH0023970400	30-gen-06	30-gen-18	1.000	2,50%
Totale CHF				5.500	
GBP					
EUROBOND t. fisso	GB0004601430	28-apr-89	28-apr-14	400	10,50%
E.M.T.N. t. fisso	XS0089572316	04-ago-98	04-ago-28	1.500	6,00%
E.M.T.N. t. fisso	XS0197336968	29-lug-04	07-dic-34	250	5,25%
Totale GBP				2.150	
NOK					
E.M.T.N. t. fisso	XS0154632011	25-set-02	25-set-12	2.000	6,15%
E.M.T.N. t. fisso	XS0170905003	23-giu-03	23-giu-15	2.000	4,34%
Totale NOK				4.000	
CZK					
E.M.T.N. t. fisso	XS0323494558	03-ott-07	03-ott-17	2.490	4,36%
E.M.T.N. t. fisso	XS0324188993	03-ott-07	03-ott-19	2.490	4,40%
E.M.T.N. t. fisso	XS0324188480	03-ott-07	03-ott-19	2.490	4,41%
Totale CZK				7.470	