

sottost.	PAGA	EURIBOR
----------	-------------	----------------

**FLUSSI PAGATI NEL PORTAFOGLIO FINANZIARIO INIZIALE AL VARIARE DEL LIVELLO DELL'EURIBOR
LIVELLI EURIBOR**

DATE PAGAMENTO	DEBITO																
	RESIDUO/IMPORNO NOZIONALE	0%	1%	2%	3%	4%	5%	6%	7%	8%	9%	10%	11%	12%	13%	14%	15%
31/12/2009	10.000.000																
30/06/2010	9.500.000	-	50.278	100.556	150.833	201.111	251.389	301.667	351.944	402.222	452.500	502.778	553.056	603.333	653.611	703.889	754.167
31/12/2010	9.000.000	-	48.556	97.111	145.667	194.222	242.778	291.333	339.889	388.444	437.000	485.556	534.111	582.667	631.222	679.778	728.333
30/06/2011	8.500.000	-	45.250	90.500	135.750	181.000	226.250	271.500	316.750	362.000	407.250	452.500	497.750	543.000	588.250	633.500	678.750
31/12/2011	8.000.000	-	43.444	86.889	130.333	173.778	217.222	260.667	304.111	347.556	391.000	434.444	477.889	521.333	564.778	608.222	651.667
30/06/2012	7.500.000	-	40.444	80.889	121.333	161.778	202.222	242.667	283.111	323.556	364.000	404.444	444.889	485.333	525.778	566.222	606.667
31/12/2012	7.000.000	-	38.333	76.667	115.000	153.333	191.667	230.000	268.333	306.667	345.000	383.333	421.667	460.000	498.333	536.667	575.000
30/06/2013	6.500.000	-	35.194	70.389	105.583	140.778	175.972	211.167	246.361	281.556	316.750	351.944	387.139	422.333	457.528	492.722	527.917
31/12/2013	6.000.000	-	33.222	66.444	99.667	132.889	166.111	199.333	232.556	265.778	299.000	332.222	365.444	398.667	431.889	465.111	498.333
30/06/2014	5.500.000	-	30.167	60.333	90.500	120.667	150.833	181.000	211.167	241.333	271.500	301.667	331.833	362.000	392.167	422.333	452.500
31/12/2014	5.000.000	-	28.111	56.222	84.333	112.444	140.556	168.667	196.778	224.889	253.000	281.111	309.222	337.333	365.444	393.556	421.667
30/06/2015	4.500.000	-	25.139	50.278	75.417	100.556	125.694	150.833	175.972	201.111	226.250	251.389	276.528	301.667	326.806	351.944	377.083
31/12/2015	4.000.000	-	23.000	46.000	69.000	92.000	115.000	138.000	161.000	184.000	207.000	230.000	253.000	276.000	299.000	322.000	345.000
30/06/2016	3.500.000	-	20.222	40.444	60.667	80.889	101.111	121.333	141.556	161.778	182.000	202.222	222.444	242.667	262.889	283.111	303.333
31/12/2016	3.000.000	-	17.889	35.778	53.667	71.556	89.444	107.333	125.222	143.111	161.000	178.889	196.778	214.667	232.556	250.444	268.333
30/06/2017	2.500.000	-	15.083	30.167	45.250	60.333	75.417	90.500	105.583	120.667	135.750	150.833	165.917	181.000	196.083	211.167	226.250
31/12/2017	2.000.000	-	12.778	25.556	38.333	51.111	63.889	76.667	89.444	102.222	115.000	127.778	140.556	153.333	166.111	178.889	191.667
30/06/2018	1.500.000	-	10.056	20.111	30.167	40.222	50.278	60.333	70.389	80.444	90.500	100.556	110.611	120.667	130.722	140.778	150.833
31/12/2018	1.000.000	-	7.667	15.333	23.000	30.667	38.333	46.000	53.667	61.333	69.000	76.667	84.333	92.000	99.667	107.333	115.000
30/06/2019	500.000	-	5.028	10.056	15.083	20.111	25.139	30.167	35.194	40.222	45.250	50.278	55.306	60.333	65.361	70.389	75.417
31/12/2019	-	-	2.556	5.111	7.667	10.222	12.778	15.333	17.889	20.444	23.000	25.556	28.111	30.667	33.222	35.778	38.333
VALORE A SCADENZA		-	532.417	1.064.833	1.597.250	2.129.667	2.662.083	3.194.500	3.726.917	4.259.333	4.791.750	5.324.167	5.856.583	6.389.000	6.921.417	7.453.833	7.986.250

flussi di cassa op. in derivati

	RICEVE	EURIBOR
derivato	PAGA	TF 5%

**DIFFERENZIALI SWAP PER LIVELLO AL VARIARE DEL LIVELLO DELL'EURIBOR
LIVELLI EURIBOR**

DATE PAGAMENTO	IMPORTO NOZIONALE	0%	1%	2%	3%	4%	5%	6%	7%	8%	9%	10%	11%	12%	13%	14%	15%
31/12/2009	10.000.000																
30/06/2010	9.500.000	- 250.000	- 199.722	- 149.444	- 99.167	- 48.889	1.389	51.667	101.944	152.222	202.500	252.778	303.056	353.333	403.611	453.889	504.167
31/12/2010	9.000.000	- 237.500	- 188.944	- 140.389	- 91.833	- 43.278	5.278	53.833	102.389	150.944	199.500	248.056	296.611	345.167	393.722	442.278	490.833
30/06/2011	8.500.000	- 225.000	- 179.750	- 134.500	- 89.250	- 44.000	1.250	46.500	91.750	137.000	182.250	227.500	272.750	318.000	363.250	408.500	453.750
31/12/2011	8.000.000	- 212.500	- 169.056	- 125.611	- 82.167	- 38.722	4.722	48.167	91.611	135.056	178.500	221.944	265.389	308.833	352.278	395.722	439.167
30/06/2012	7.500.000	- 200.000	- 159.556	- 119.111	- 78.667	- 38.222	2.222	42.667	83.111	123.556	164.000	204.444	244.889	285.333	325.778	366.222	406.667
31/12/2012	7.000.000	- 187.500	- 149.167	- 110.833	- 72.500	- 34.167	4.167	42.500	80.833	119.167	157.500	195.833	234.167	272.500	310.833	349.167	387.500
30/06/2013	6.500.000	- 175.000	- 139.806	- 104.611	- 69.417	- 34.222	972	36.167	71.361	106.556	141.750	176.944	212.139	247.333	282.528	317.722	352.917
31/12/2013	6.000.000	- 162.500	- 129.278	- 96.056	- 62.833	- 29.611	3.611	36.833	70.056	103.278	136.500	169.722	202.944	236.167	269.389	302.611	335.833
30/06/2014	5.500.000	- 150.000	- 119.833	- 89.667	- 59.500	- 29.333	833	31.000	61.167	91.333	121.500	151.667	181.833	212.000	242.167	272.333	302.500
31/12/2014	5.000.000	- 137.500	- 109.389	- 81.278	- 53.167	- 25.056	3.056	31.167	59.278	87.389	115.500	143.611	171.722	199.833	227.944	256.056	284.167
30/06/2015	4.500.000	- 125.000	- 99.861	- 74.722	- 49.583	- 24.444	694	25.833	50.972	76.111	101.250	126.389	151.528	176.667	201.806	226.944	252.083
31/12/2015	4.000.000	- 112.500	- 89.500	- 66.500	- 43.500	- 20.500	2.500	25.500	48.500	71.500	94.500	117.500	140.500	163.500	186.500	209.500	232.500
30/06/2016	3.500.000	- 100.000	- 79.778	- 59.556	- 39.333	- 19.111	1.111	21.333	41.556	61.778	82.000	102.222	122.444	142.667	162.889	183.111	203.333
31/12/2016	3.000.000	- 87.500	- 69.611	- 51.722	- 33.833	- 15.944	1.944	19.833	37.722	55.611	73.500	91.389	109.278	127.167	145.056	162.944	180.833
30/06/2017	2.500.000	- 75.000	- 59.917	- 44.833	- 29.750	- 14.667	417	15.500	30.583	45.667	60.750	75.833	90.917	106.000	121.083	136.167	151.250
31/12/2017	2.000.000	- 62.500	- 49.722	- 36.944	- 24.167	- 11.389	1.389	14.167	26.944	39.722	52.500	65.278	78.056	90.833	103.611	116.389	129.167
30/06/2018	1.500.000	- 50.000	- 39.944	- 29.889	- 19.833	- 9.778	278	10.333	20.389	30.444	40.500	50.556	60.611	70.667	80.722	90.778	100.833
31/12/2018	1.000.000	- 37.500	- 29.833	- 22.167	- 14.500	- 6.833	833	8.500	16.167	23.833	31.500	39.167	46.833	54.500	62.167	69.833	77.500
30/06/2019	500.000	- 25.000	- 19.972	- 14.944	- 9.917	- 4.889	139	5.167	10.194	15.222	20.250	25.278	30.306	35.333	40.361	45.389	50.417
31/12/2019	-	- 12.500	- 9.944	- 7.389	- 4.833	- 2.278	278	2.833	5.389	7.944	10.500	13.056	15.611	18.167	20.722	23.278	25.833
VALORE A SCADENZA	-	- 2.625.000	- 2.092.583	- 1.560.167	- 1.027.750	- 495.333	37.083	569.500	1.101.917	1.634.333	2.166.750	2.699.167	3.231.583	3.764.000	4.296.417	4.828.833	5.361.250