

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

## SITUAZIONE TITOLI GESTORE AXA INVESTMENT MANAGERS

(LINEA MONETARIA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
CAJASUR INTL FIN	EUR	1.000.000	99,718	100,000	1,000	997.181,85	1.000.000,00	2.818,15
OKO BANK	EUR	1.500.000	99,959	99,525	1,000	1.499.381,85	1.492.875,00	-6.506,85
AMER HONDA FIN CP FLTG RATE	EUR	1.500.000	99,950	99,410	1,000	1.499.250,00	1.491.150,00	-8.100,00
ROYAL BK OF SCOTLAND RBS	EUR	2.000.000	100,405	95,270	1,000	2.008.100,00	1.905.400,00	-102.700,00
FINBP 07/14/09 FRN MTN	EUR	2.000.000	99,949	99,785	1,000	1.998.972,69	1.995.700,00	-3.272,69
ANGL 07/13/09 FRN MTN	EUR	1.000.000	100,005	98,035	1,000	1.000.046,58	980.350,00	-19.696,58
ERST 07/19/17 '12 MTN	EUR	1.000.000	99,965	94,000	1,000	999.649,03	940.000,00	-59.649,03
SPI 07/21/08 FRN MTN	EUR	500.000	100,034	99,957	1,000	500.172,36	499.785,00	-387,36
WB 08/01/11 FRN MTN	EUR	2.000.000	99,867	95,460	1,000	1.997.343,58	1.909.200,00	-88.143,58
CAGR 09/30/08 FRN M	EUR	2.000.000	99,975	99,970	1,000	1.999.500,00	1.999.400,00	-100,00
CRGI 09/28/09 FRN M	EUR	2.000.000	99,979	99,547	1,000	1.999.579,53	1.990.930,00	-8.649,53
BNP 10/17/16 '11 MTN	EUR	2.000.000	100,235	98,245	1,000	2.004.700,07	1.964.900,00	-39.800,07
PEUP 3.663 11/03/08 FRN M	EUR	2.000.000	99,955	99,895	1,000	1.999.100,00	1.997.900,00	-1.200,00
BESN 11/13/09 FRN M	EUR	1.300.000	99,999	99,385	1,000	1.299.982,34	1.292.005,00	-7.977,34
BDELL 02/11/09 FRN M	EUR	1.000.000	100,084	99,853	1,000	1.000.843,30	998.534,00	-2.309,30
BPUN 12/22/08 FRN M	EUR	2.000.000	100,000	99,858	1,000	2.000.000,00	1.997.166,00	-2.834,00
EFG03/28/12 FRN M	EUR	1.500.000	99,923	99,461	1,000	1.498.842,71	1.491.912,00	-6.930,71
VOWG 03/23/10 FRN M	EUR	1.000.000	99,914	99,557	1,000	999.140,00	995.568,00	-3.572,00
TEF03/30/09 FRN M	EUR	1.000.000	99,961	99,713	1,000	999.610,00	997.129,00	-2.481,00
SOGN 06/07/17 '12 M	EUR	1.000.000	99,936	96,002	1,000	999.358,52	960.019,00	-39.339,52
TLIT 4.325 06/07/10 FRN	EUR	2.000.000	99,931	99,321	1,000	1.998.621,06	1.986.420,00	-12.201,06
DEX1 07/09/17 '12 M	EUR	1.000.000	99,827	98,700	1,000	998.267,19	987.000,00	-11.267,19
<b>TOTALE OBBLIGAZIONARIO</b>						<b>148.845.746,73</b>	<b>146.434.814,00</b>	<b>-2.410.932,73</b>

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE MONTE PASCHI ASSET MANAGEMENT SGR S.p.A.**

(LINEA MONETARIA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
<b>OBBLIGAZIONARIO</b>								
SAB 05/25/16 '11 FRN	EUR	3.000.000	99,889	95,311	1,000	2.996.678,79	2.859.330,00	-137.348,79
CAZAR04/25/19 '14 F	EUR	4.500.000	100,000	96,505	1,000	4.500.000,00	4.342.725,00	-157.275,00
CCT-NV11 IND	EUR	6.000.000	100,490	100,340	1,000	6.029.400,00	6.020.400,00	-9.000,00
CCT-1MZ12 IND	EUR	6.500.000	100,580	100,350	1,000	6.537.700,00	6.522.750,00	-14.950,00
CCT-INV12 IND	EUR	8.500.000	100,500	100,360	1,000	8.542.500,00	8.530.600,00	-11.900,00
CCT-LG13 IND	EUR	23.000.000	100,838	100,380	1,000	23.192.740,00	23.087.400,00	-105.340,00
CCT-1MZ14IND	EUR	26.000.000	100,800	100,400	1,000	26.208.000,00	26.104.000,00	-104.000,00
F.VAN LANSCHOT16FRN	EUR	3.000.000	99,905	97,895	1,000	2.997.142,91	2.936.850,00	-60.292,91
CRDIT FLOAT 11/15	EUR	3.000.000	98,850	94,425	1,000	2.965.500,00	2.832.750,00	-132.750,00
IBSANP FLOAT 18	EUR	4.000.000	99,646	95,000	1,000	3.985.839,62	3.800.000,00	-185.839,62
FRN 01 MAR 2006 - 2013 EMTN	EUR	2.700.000	100,060	94,984	1,000	2.701.620,00	2.564.568,00	-137.052,00
HBOS FLOAT 03/16	EUR	3.000.000	98,658	96,205	1,000	2.959.732,83	2.886.150,00	-73.582,83
JYSKE BANK	EUR	2.000.000	99,582	95,655	1,000	1.991.631,45	1.913.100,00	-78.531,45
BCA CARIGE SPA	EUR	6.000.000	99,889	96,455	1,000	5.993.339,21	5.787.300,00	-206.039,21
MER09/14/18 FRN M	EUR	6.000.000	99,824	84,997	1,000	5.989.448,90	5.099.820,00	-889.628,90
OTVV 11/28/16 FRN M	EUR	3.050.000	99,969	96,050	1,000	3.049.044,97	2.929.525,00	-119.519,97
STANLN FLOAT 18	EUR	4.700.000	99,544	95,358	1,000	4.678.547,69	4.481.807,20	-196.740,49
BL 12/19/16 '11 M	EUR	4.000.000	99,964	96,631	1,000	3.998.547,50	3.865.232,00	-133.315,50
CDADM04/26/17 '12 F	EUR	3.700.000	99,831	91,956	1,000	3.693.759,50	3.402.386,80	-291.372,70
EMII 05/15/17 FRN M	EUR	4.400.000	99,916	95,827	1,000	4.396.289,36	4.216.388,00	-179.901,36
VOD06/06/14 FRN	EUR	2.250.000	100,000	97,076	1,000	2.250.000,00	2.184.216,75	-65.783,25
<b>TOTALE OBBLIGAZIONARIO</b>						<b>129.657.462,73</b>	<b>126.367.298,75</b>	<b>-3.290.163,98</b>

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

## SITUAZIONE TITOLI GESTORE ALLIANZ PIMCO SGR S.p.A.

(LINEA MONETARIA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
<b>OBBLIGAZIONARIO AREA EURO</b>								
BANCAJA 9 43 FRN	EUR	1.504.067,17	98,308	100,000	1,000	1.478.624,57	1.504.067,17	25.442,60
UCI 4.980 03/17/33 FRN	EUR	822.609,55	100,780	97,690	1,000	829.025,30	803.607,28	-25.418,02
HIPOCAT8 38 FRN A2	EUR	73.655,13	97,130	97,747	1,000	71.541,05	71.995,90	454,85
IM CAJAMAR 3 F T A 20480922	EUR	1.280.635,84	98,024	99,500	1,000	1.255.329,51	1.274.232,66	18.903,15
IM PASTOR 4 FTA/TV 20440322	EUR	1.283.460,90	103,039	98,094	1,000	1.322.461,57	1.258.998,14	-63.463,43
AYT KUTXA HIPOTECARIO J FLO	EUR	665.952,49	96,270	95,950	1,000	641.111,44	638.981,41	-2.130,03
TDAFT 4.806 12/28/50 FRN	EUR	250.380,84	99,541	100,090	1,000	249.230,72	250.606,18	1.375,46
UCI 15 FTA/TV 20481218 CLAS	EUR	287.405,36	97,270	98,780	1,000	279.559,20	283.899,01	4.339,81
SAHI 01/18/49 FRN	EUR	1.746.945,48	96,323	96,740	1,000	1.682.717,19	1.689.995,06	7.277,87
FRANCLIA 4,75% 2035	EUR	5.300.000,00	101,200	101,460	1,000	5.363.618,61	5.377.380,00	13.761,39
CREDIT LOGEMENT 2007-2017 T	EUR	100.000,00	95,800	94,260	1,000	95.800,14	94.260,00	-1.540,14
BTP-1FB17 4%	EUR	6.100.000,00	96,651	95,930	1,000	5.895.700,70	5.851.730,00	-43.970,70
BBVSASM FLOAT-12	EUR	100.000,00	96,213	96,235	1,000	96.213,41	96.235,00	21,59
WESTPAC BANKING CORPORATION	EUR	150.000,00	97,138	95,980	1,000	145.706,97	143.970,00	-1.736,97
UNICREDITO 15 FRN	EUR	1.500.000,00	98,834	97,215	1,000	1.482.510,08	1.458.225,00	-24.285,08
HSBC BK 20 FRN	EUR	1.700.000,00	96,084	92,495	1,000	1.633.420,33	1.572.415,00	-61.005,33
UBS AG 15 FRN	EUR	1.700.000,00	98,504	96,500	1,000	1.674.567,31	1.640.500,00	-34.067,31
NDA4.066 03/08/16 '11 M	EUR	1.700.000,00	97,783	97,330	1,000	1.662.304,59	1.654.610,00	-7.694,59
EIB 3.750 11/24/10 MTN	EUR	71.873.000,00	98,860	98,619	1,000	71.053.404,06	70.880.433,87	-172.970,19
SAN4.147 03/23/17 '12 M	EUR	1.700.000,00	97,157	95,459	1,000	1.651.669,97	1.622.797,90	-28.872,07
HBOS 03/21/17 '12 M	EUR	1.500.000,00	97,616	95,221	1,000	1.464.241,99	1.428.310,50	-35.931,49
BARCLAYS BANK PLC/TV EMTN 2	EUR	1.700.000,00	97,106	95,404	1,000	1.650.799,27	1.621.866,30	-28.932,97
BT 5.250 01/22/13 MTN	EUR	200.000,00	99,841	98,927	1,000	199.682,69	197.853,40	-1.829,29
ABN AMRO BANK zc	EUR	4.300.000,00	99,544	99,544	1,000	4.280.394,01	4.280.394,01	-
DEXIA FIN PRO zc	EUR	5.300.000,00	99,549	99,549	1,000	5.276.088,24	5.276.088,24	-
SOGN 6.999 PERP '17 F	EUR	1.200.000,00	101,934	101,703	1,000	1.223.208,04	1.220.436,00	-2.772,04
<b>OBBLIGAZIONARIO STATI UNITI</b>								
CITIGROUP 6,125 21/11/17	USD	500.000,00	99,577	102,565	1,472	338.213,05	348.362,88	10.149,83
C 8.300 12/21/77 '37 F	USD	1.100.000,00	99,759	104,715	1,472	745.431,73	782.466,82	37.035,09
CBA 5.800 08/11/14 '09 M	USD	2.000.000,00	99,164	99,779	1,472	1.347.248,62	1.355.600,84	8.352,22
THE ROYAL BK SCOTLAND 2004	USD	100.000,00	97,475	96,000	1,472	66.214,69	65.212,96	-1.001,73

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE ALLIANZ PIMCO SGR S.p.A.**

(LINEA MONETARIA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
THE ROYAL BANK OF SCOTLAND	USD	2.700.000,00	97,261	96,122	1,472	1.783.875,95	1.762.987,57	-20.888,38
<b>OBBLIGAZIONARIO POOL FACTOR</b>								
FCCPP 4.833 08/02/17 FRN	EUR	185.106,53	94,782	96,750	1,000	175.446,80	179.090,57	3.643,77
AUBCM 4.787 02/25/19 FRN	EUR	200.000,00	98,219	98,210	1,000	196.438,37	196.420,00	-18,37
INTESABCI	EUR	1.178.326,53	98,900	99,331	1,000	1.165.364,96	1.170.437,63	5.072,67
VELA HOME	EUR	276.693,09	99,900	99,273	1,000	276.416,35	274.680,15	-1.736,20
SIENA M-38 A2 FRN	EUR	1.452.754,00	99,795	98,680	1,000	1.449.776,57	1.433.577,65	-16.198,92
LOCAT VEHIC	EUR	516.915,90	99,270	98,970	1,000	513.142,41	511.591,67	-1.550,74
SPLIT 2/TV 20181025 CL A SE	EUR	1.548.464,40	99,455	99,160	1,000	1.540.025,33	1.535.457,30	-4.568,03
ITALEASE-20 A2 FRN	EUR	500.000,00	96,662	98,200	1,000	483.310,00	491.000,00	7.690,00
TIT.SCIP 05/25	EUR	1.692.342,14	99,635	99,570	1,000	1.686.167,17	1.685.065,07	-1.102,10
CORDUSIO 33	EUR	1.566.518,04	98,064	98,100	1,000	1.536.197,20	1.536.754,20	557,00
LOMBARDA-22 A FRN	EUR	1.651.267,06	98,864	99,600	1,000	1.632.515,31	1.644.661,99	12.146,68
VELA L-28 A S2 FRN	EUR	1.700.000,00	98,663	99,230	1,000	1.677.269,17	1.686.910,00	9.640,83
VELA H-40 A IND	EUR	1.932.751,21	98,777	100,000	1,000	1.909.106,04	1.932.751,21	23.645,17
F-E- GOLD-25 A2 FRN	EUR	200.000,00	98,370	98,675	1,000	196.740,01	197.349,80	609,79
BPM SEC-06/43 2CL A2	EUR	1.700.000,00	98,907	96,620	1,000	1.681.417,76	1.642.540,00	-38.877,76
AGRISEC-23 1-A2FRN	EUR	1.700.000,00	98,721	100,000	1,000	1.678.253,35	1.700.000,00	21.746,65
VOBA F-43 A2 FRN	EUR	200.000,00	97,961	97,690	1,000	195.921,26	195.380,00	-541,26
LOCAT SV06-28 A2 FRN	EUR	1.200.000,00	98,771	97,500	1,000	1.185.247,56	1.170.000,00	-15.247,56
INTESA SEC 3/TV 20331030 CL	EUR	600.000,00	97,941	98,406	1,000	587.646,62	590.435,40	2.788,78
BP MRTG-43 A2 FRN	EUR	1.700.000,00	98,560	97,070	1,000	1.675.519,98	1.650.190,00	-25.329,98
MECENATE-48 A FRN	EUR	1.700.000,00	98,720	98,850	1,000	1.678.239,98	1.680.450,00	2.210,02
CASTM 4.505 07/18/27 FRN	EUR	124.846,86	109,487	99,990	1,000	136.690,85	124.834,38	-11.856,47
EMERALD MORTGAGES PLC 01-28	EUR	212.889,53	97,840	100,000	1,000	208.291,13	212.889,53	4.598,40
HOLLAND EURO-DENOMINATED MO	EUR	185.874,51	99,960	99,720	1,000	185.799,59	185.354,06	-445,53
DELPHINUS/TV 20311128 A1	EUR	650.122,00	100,004	99,710	1,000	650.150,70	648.236,65	-1.914,05
HOLLAND EURO-DENOMINATED MO	EUR	243.247,09	99,950	99,625	1,000	243.124,74	242.334,91	-789,83
EMERALD MORTGAGES PLC-03/35	EUR	173.524,96	98,850	98,850	1,000	171.529,43	171.529,43	-
DUTCH MORTGAGE PORTFOLIO LO	EUR	1.288.223,15	99,883	99,110	1,000	1.286.721,08	1.276.757,96	-9.963,12
MONASTERY 2003-1 BV- TV 204	EUR	164.120,00	99,730	99,670	1,000	163.676,87	163.578,40	-98,47
MAGELLAN/TV 20360718 A2	EUR	703.562,98	99,459	99,500	1,000	699.760,06	700.045,17	285,11

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE ALLIANZ PIMCO SGR S.p.A.**

(LINEA MONETARIA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
SAECURE 3 BV/TV 20511125 CL	EUR	508.106,00	99,874	99,890	1,000	507.463,84	507.547,08	83,24
ATOMIUM MORTGAGE FINANCE 20	EUR	1.701.876,00	99,745	99,800	1,000	1.697.532,14	1.698.472,25	940,11
HOLLAND HOMES MBS BV 2003-1	EUR	1.291.522,71	99,474	99,730	1,000	1.284.732,88	1.288.035,59	3.302,71
LADEF 5.045 04/09/09 FRN	EUR	59.355,34	99,584	99,540	1,000	59.108,32	59.082,31	-26,01
PERMANENT FIN 4/TV 20420610	EUR	500.000,00	99,674	99,235	1,000	498.370,48	496.175,00	-2.195,48
ARENA 2004 II BV - EMTN TV	EUR	1.337.752,00	99,022	99,100	1,000	1.324.671,19	1.325.712,23	1.041,04
HOLMES FINANCING (N.9) PLC-	EUR	800.000,00	99,499	98,690	1,000	795.990,47	789.520,00	-6.470,47
PERMANT FIN 6/TV MBS 204206	EUR	500.000,00	99,614	99,620	1,000	498.070,56	498.100,00	29,44
LUSITANO 47 FRN A3	EUR	358.146,30	97,950	100,000	1,000	350.804,86	358.146,30	7.341,44
HERMES IX/TV 20390518 A	EUR	189.694,79	98,679	97,670	1,000	187.188,93	185.274,90	-1.914,03
SAECURE 5 BV 05-42 TV CLASS	EUR	690.515,86	99,248	98,340	1,000	685.320,07	679.053,29	-6.266,78
STORM 2005 BV-TV 05/47	EUR	1.582.820,00	98,993	100,200	1,000	1.566.875,25	1.585.985,64	19.110,39
PERMANENT FINANCING (N.8) P	EUR	1.700.000,00	99,477	99,270	1,000	1.691.112,10	1.687.590,00	-3.522,10
MAGELLAN MTG 3/TV MBS 20580	EUR	144.092,80	98,285	97,815	1,000	141.622,13	140.944,37	-677,76
DECO 2005-PAN EUROPE I PLC	EUR	12.613,55	98,658	98,670	1,000	12.444,28	12.445,79	1,51
LUSITANO MORT 4/TV 20480915	EUR	1.028.795,13	98,547	98,905	1,000	1.013.845,32	1.017.529,82	3.684,50
DUTCH MTG PORTF LOANS V 201	EUR	276.473,11	99,267	98,755	1,000	274.446,22	273.031,02	-1.415,20
STICHTING HOLLAND HOMES III	EUR	1.194.322,18	98,818	99,180	1,000	1.180.209,48	1.184.528,74	4.319,26
CERSI 4.186 03/24/12 FRN	EUR	167.606,09	99,770	99,770	1,000	167.220,60	167.220,59	-0,01
LOTHIAN MORTGAGES MASTER IS	EUR	1.100.000,00	99,289	99,170	1,000	1.092.178,46	1.090.870,00	-1.308,46
FASTNET SECURITIES PLC 2006	EUR	1.000.000,00	97,596	97,970	1,000	975.960,03	979.700,00	3.739,97
ARRAN RESIDENTIAL MORTGAGES	EUR	500.000,00	99,398	98,800	1,000	496.989,79	494.000,00	-2.989,79
GRND I A 20.07.2016	EUR	273.918,00	97,318	98,212	1,000	266.571,75	269.020,89	2.449,14
CERSI04/10/48 FRN	EUR	1.300.000,00	98,749	98,710	1,000	1.283.743,43	1.283.230,00	-513,43
ABBEY4.279 07/15/21 FRN	EUR	1.700.000,00	99,211	99,090	1,000	1.686.592,23	1.684.530,00	-2.062,23
OPEGR 4.195 01/22/13 FRN	EUR	1.400.000,00	97,907	97,200	1,000	1.370.702,90	1.360.800,00	-9.902,90
MONAS 4.665 11/17/44 '12 F	EUR	700.000,00	99,202	98,013	1,000	694.415,78	686.091,00	-8.324,78
BBVA SUB CAPITAL UNIPERS	EUR	1.700.000,00	98,114	96,260	1,000	1.667.929,66	1.636.420,00	-31.509,66
ARPEC 4.625 05/17/12 FRN M	EUR	1.200.000,00	98,007	97,010	1,000	1.176.082,62	1.164.120,00	-11.962,62
BELUGA MASTER IS/TV 2099042	EUR	1.500.000,00	99,390	98,498	1,000	1.490.850,00	1.477.474,50	-13.375,50
ARKLE MASTER ISSUER PLC 200	EUR	550.000,00	98,364	98,745	1,000	541.001,79	543.094,75	2.092,96
BRUNEL RES MTG SEC FRN M/BK	EUR	1.300.000,00	99,000	98,193	1,000	1.287.000,17	1.276.506,41	-10.493,76

## SITUAZIONE TITOLI GESTORE ALLIANZ PIMCO SGR S.p.A.

(LINEA MONETARIA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
MESDAG BV/TV 20191025 CHAR	EUR	277.600,16	95,206	97,544	1,000	264.292,22	270.781,47	6.489,25
PANEE 4.399 01/27/14 FRN	EUR	498.779,56	95,007	95,020	1,000	473.876,43	473.940,34	63,91
HIPOTOTTA N 5/TV 20600228 A	EUR	500.000,00	97,338	98,464	1,000	486.691,25	492.320,50	5.629,25
IMMEO RES/TV 20161206	EUR	198.155,60	97,032	97,815	1,000	192.273,59	193.824,91	1.551,32
DECO SERIES HOLDINGS LTD 28	EUR	390.736,01	95,124	96,990	1,000	371.683,63	378.974,86	7.291,23
CARS ALLIANCE FUNDING PLC 0	EUR	400.000,00	98,124	98,697	1,000	392.495,82	394.787,20	2.291,38
<b>OBBLIGAZIONARIO POOL FACTOR GRAN BRETAGNA</b>								
ARRAN RESIDENTIAL MORTAGES	GBP	200.000,00	98,742	98,744	0,733	269.291,02	269.295,70	4,68
<b>TOTALE OBBLIGAZIONARIO</b>						<b>174.223.473,34</b>	<b>173.712.999,68</b>	<b>-510.473,66</b>

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE CAPITALIA ASSET MANAGEMENT**

(LINEA BILANCIATA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
<b>AZIONARIO AREA EURO</b>								
ADIDAS SALOMON	EUR	30.000	47,257	50,930	1,000	1.417.707,76	1.527.900,00	110.192,24
BAY MOTOREN WERKE	EUR	30.000	42,960	42,730	1,000	1.288.804,41	1.281.900,00	-6.904,41
DEUTSCHE TELEKOM	EUR	140.000	13,801	15,030	1,000	1.932.141,61	2.104.200,00	172.058,39
BAYER AG	EUR	30.000	56,901	62,370	1,000	1.707.039,95	1.871.100,00	164.060,05
BILFINGER BERGER	EUR	50.000	66,092	51,960	1,000	3.304.600,94	2.598.000,00	-706.600,94
DAIMLERCHRYSLER	EUR	40.000	65,000	66,210	1,000	2.599.984,88	2.648.400,00	48.415,12
SIEMENS AG.	EUR	40.000	95,597	108,420	1,000	3.823.890,06	4.336.800,00	512.909,94
E.ON AG	EUR	35.000	119,272	145,610	1,000	4.174.521,65	5.096.350,00	921.828,35
ALLIANZ AG	EUR	5.000	179,134	148,080	1,000	895.669,16	740.400,00	-155.269,16
BCO SANT CENTRAL HISPANO	EUR	260.000	13,910	14,790	1,000	3.616.697,10	3.845.400,00	228.702,90
TELEFONICA SA	EUR	178.000	18,318	22,220	1,000	3.260.656,48	3.955.160,00	694.503,52
NOKIA -A-	EUR	60.000	21,663	26,520	1,000	1.299.762,94	1.591.200,00	291.437,06
GENERALE DE SANTE	EUR	44.500	30,710	23,200	1,000	1.366.575,55	1.032.400,00	-334.175,55
AIR LIQUIDE	EUR	20.000	94,294	101,790	1,000	1.885.874,38	2.035.800,00	149.925,62
CARREFOUR	EUR	35.000	49,161	53,290	1,000	1.720.646,26	1.865.150,00	144.503,74
TOTAL	EUR	40.000	54,614	56,830	1,000	2.184.547,92	2.273.200,00	88.652,08
SANOFI SYNTHELABO	EUR	20.000	59,417	62,980	1,000	1.188.332,63	1.259.600,00	71.267,37
AXA SA	EUR	15.333	30,855	27,390	1,000	473.102,12	419.970,87	-53.131,25
LVMH	EUR	15.000	84,945	82,680	1,000	1.274.181,60	1.240.200,00	-33.981,60
VIVENDI UNIVERSAL	EUR	65.000	30,772	31,380	1,000	2.000.176,24	2.039.700,00	39.523,76
SOCIETE GENERALE SA	EUR	7.500	132,645	98,930	1,000	994.840,76	741.975,00	-252.865,76
BNP-PARIBAS	EUR	20.000	81,387	74,220	1,000	1.627.730,87	1.484.400,00	-143.330,87
FRANCE TELECOM	EUR	145.000	21,331	24,620	1,000	3.092.959,13	3.569.900,00	476.940,87
ALSTOM REGPT	EUR	16.000	106,938	147,000	1,000	1.711.010,79	2.352.000,00	640.989,21
BULL SA - AZ DE REGROUPEMEN	EUR	400.000	5,506	3,790	1,000	2.202.481,34	1.516.000,00	-686.481,34
ROYAL DUTCH SHELL-A	EUR	55.000	30,351	28,750	1,000	1.669.329,57	1.581.250,00	-88.079,57
GENERALI ASS. ORD.	EUR	60.000	30,245	31,000	1,000	1.814.727,27	1.860.000,00	45.272,73
UNICREDITO IT. ORD.	EUR	230.000	6,514	5,679	1,000	1.498.253,22	1.306.170,00	-192.083,22
SAIPEM ORD.	EUR	75.000	28,176	27,410	1,000	2.113.210,87	2.055.750,00	-57.460,87

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE CAPITALIA ASSET MANAGEMENT**

(LINEA BILANCIATA)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
AEM ORD.	EUR	800.000	2,704	3,138	1,000	2.163.183,38	2.510.400,00	347.216,62
MARIELLA BURANI	EUR	134.444	20,330	18,790	1,000	2.733.246,52	2.526.202,76	-207.043,76
ENEL ORD.	EUR	100.000	7,763	8,135	1,000	776.298,04	813.500,00	37.201,96
ENI ORD.	EUR	85.000	25,603	25,050	1,000	2.176.265,00	2.129.250,00	-47.015,00
ESPIRITO SAN FIN EUR ORD	EUR	65.000	30,506	23,740	1,000	1.982.858,86	1.543.100,00	-439.758,86
ARCELORMITTAL ORD	EUR	17.000	45,836	53,250	1,000	779.219,52	905.250,00	126.030,48
KONINK.KPN	EUR	200.000	10,868	12,440	1,000	2.173.688,50	2.488.000,00	314.311,50
UNILEVER NV	EUR	170.000	21,676	25,150	1,000	3.684.899,49	4.275.500,00	590.600,51
PHILIPS ELECTRONICS NV	EUR	30.000	30,486	29,520	1,000	914.567,10	885.600,00	-28.967,10
AHOLD KON	EUR	103.000	11,276	9,480	1,000	1.161.443,93	976.440,00	-185.003,93
<b>TOTALE AZIONARIO</b>						<b>76.685.127,80</b>	<b>79.283.518,63</b>	<b>2.598.390,83</b>
<b>OBLIGAZIONARIO</b>								
BTP-15GN08 2,5%	EUR	10.000.000	98,198	99,302	1,000	9.819.800,00	9.930.200,00	110.400,00
CCT TV 01.02.03/2010	EUR	10.000.000	100,530	100,320	1,000	10.053.000,00	10.032.000,00	-21.000,00
CCT TV 01.06.03/2010	EUR	10.000.000	100,500	100,330	1,000	10.050.000,00	10.033.000,00	-17.000,00
CCT TV 01.10.02/2009	EUR	12.950.000	100,466	100,310	1,000	13.010.360,50	12.990.145,00	-20.215,50
CCT TV 1.12.2010	EUR	10.000.000	100,530	100,340	1,000	10.053.000,00	10.034.000,00	-19.000,00
CCT-1MZ12 IND	EUR	15.000.000	100,580	100,350	1,000	15.087.000,00	15.052.500,00	-34.500,00
CCT-INV12 IND	EUR	15.000.000	100,500	100,360	1,000	15.075.000,00	15.054.000,00	-21.000,00
CCT-LG13 IND	EUR	13.700.000	100,560	100,380	1,000	13.776.720,00	13.752.060,00	-24.660,00
CCT-NV11 IND	EUR	12.900.000	100,508	100,340	1,000	12.965.501,00	12.943.860,00	-21.641,00
CTZ	EUR	11.000.000	95,844	96,004	1,000	10.542.873,00	10.560.440,00	17.567,00
<b>TOTALE OBLIGAZIONARIO</b>						<b>120.433.254,50</b>	<b>120.382.205,00</b>	<b>-51.049,50</b>
<b>TOTALE GENERALE</b>						<b>197.118.382,30</b>	<b>199.665.723,63</b>	<b>2.547.341,33</b>



## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE PIONEER INVESTMENT MANAGEMENT SGR S.p.A.**  
 (LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
<b>AZIONARIO CANADESE</b>								
AGRIUM ORD	CAD	5.070	53,766	71,670	1,445	188.660,06	251.482,39	62.822,33
<b>AZIONARIO SVIZZERO</b>								
SYNGENTA AG	CHF	936	248,227	288,500	1,655	140.412,68	163.193,33	22.780,65
ROCHE HOLDING AG	CHF	4.861	211,335	195,600	1,655	620.836,02	574.612,68	-46.223,34
<b>AZIONARIO AREA EURO</b>								
OMV AG	EUR	4.016	49,054	55,420	1,000	197.002,76	222.566,72	25.563,96
GIMV	EUR	2.508	47,420	46,850	1,000	118.929,36	117.499,80	-1.429,56
BNK CYPRUS PUB/R ORD	EUR	27.077	12,940	12,500	1,000	350.379,07	338.462,50	-11.916,57
DEUTSCHE TELEKOM	EUR	13.640	14,592	15,030	1,000	199.038,37	205.009,20	5.970,83
BAYER AG	EUR	7.036	53,128	62,370	1,000	373.807,05	438.835,32	65.028,27
INFINEON TECHNOLOGIES	EUR	33.399	11,995	8,120	1,000	400.618,96	271.199,88	-129.419,08
RHEINMETALL	EUR	3.930	62,456	54,820	1,000	245.452,54	215.442,60	-30.009,94
MUENCHENER RUECKVER	EUR	2.184	133,800	132,850	1,000	292.219,41	290.144,40	-2.075,01
BCO SANT CENTRAL HISPANO	EUR	21.354	14,095	14,790	1,000	300.984,86	315.825,66	14.840,80
REPSOL SA	EUR	10.216	25,401	24,380	1,000	259.496,19	249.066,08	-10.430,11
TELEFONICA SA	EUR	15.916	22,465	22,220	1,000	357.558,59	353.653,52	-3.905,07
CARREFOUR	EUR	6.854	49,848	53,290	1,000	341.659,74	365.249,66	23.589,92
EUTELSAT COMM.	EUR	34.042	15,985	20,350	1,000	544.169,14	692.754,70	148.585,56
EDF	EUR	4.122	83,013	81,480	1,000	342.180,82	335.860,56	-6.320,26
ROYAL DUTCH SHELL-A	EUR	3.698	20,355	28,750	1,000	75.274,57	106.317,50	31.042,93
DANIELI RISP NC	EUR	11.827	19,436	16,290	1,000	229.875,19	192.661,83	-37.213,36
UNIPOL PRIV	EUR	71.282	2,387	2,168	1,000	170.155,11	154.539,38	-15.615,73
AEM ORD.	EUR	76.703	2,890	3,138	1,000	221.702,10	240.694,01	18.991,91
TELECOM ITALIA ORD.	EUR	122.363	2,178	2,125	1,000	266.525,36	260.021,38	-6.503,98
FINMECCANICA	EUR	7.691	21,072	21,970	1,000	162.068,14	168.971,27	6.903,13
BANCO POPOLARE	EUR	33.662	17,268	15,160	1,000	581.283,88	510.315,92	-70.967,96
UNILEVER NV	EUR	9.634	22,930	25,150	1,000	220.911,49	242.295,10	21.383,61
EUR.AER.DEF.SP. NV	EUR	6.113	23,836	22,000	1,000	145.711,92	134.486,00	-11.225,92
ING GROEP	EUR	11.910	26,863	26,750	1,000	319.935,62	318.592,50	-1.343,12
SONAE SGPS	EUR	152.157	2,149	1,980	1,000	326.984,47	301.270,86	-25.713,61
<b>AZIONARIO GRAN BRETAGNA</b>								
MORRISON SUPERMARKETS	GBP	76.239	3,020	3,220	0,733	313.944,51	334.750,91	20.806,40
CADBURY SCHWEPES	GBP	25.536	6,162	6,210	0,733	214.552,41	216.238,58	1.686,17

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE PIONEER INVESTMENT MANAGEMENT SGR S.p.A.**  
 (LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
PERSIMMON	GBP	12.062	10,607	8,000	0,733	174.455,28	131.582,46	-42.872,82
REED ELSEVIER	GBP	33.785	5,810	6,795	0,733	267.672,23	313.041,62	45.369,39
TESCO PLC	GBP	47.691	4,587	4,773	0,733	298.300,17	310.363,81	12.063,64
ASTRAZENECA	GBP	17.858	23,293	21,640	0,733	567.209,99	526.961,37	-40.248,62
BARCLAYS	GBP	30.718	5,215	5,040	0,733	218.447,55	211.111,64	-7.335,91
INMARSAT	GBP	31.604	3,880	5,430	0,733	167.216,92	234.007,94	66.791,02
VODAFONE GROUP ORD USD0.114	GBP	161.828	1,828	1,878	0,733	403.435,44	414.417,38	10.981,94
<b>AZIONARIO GIAPPONESE</b>								
ASAHI GLASS	JPY	21.000	1.623,460	1.499,000	164,930	206.709,94	190.862,79	-15.847,15
CANON INC.	JPY	6.750	6.544,947	5.200,000	164,930	267.861,45	212.817,56	-55.043,89
KURITA WATER IND	JPY	18.600	3.151,861	3.390,000	164,930	355.451,51	382.307,65	26.856,14
KOMATSU LTD	JPY	5.700	2.748,530	3.040,000	164,930	94.989,52	105.062,75	10.073,23
SHARP CORP.	JPY	26.000	2.241,885	2.010,000	164,930	353.416,69	316.861,70	-36.554,99
J.FRONT RETAILIN ORD	JPY	46.000	1.108,916	987,000	164,930	309.283,67	275.280,42	-34.003,25
SUZUKI MOTOR CORP	JPY	7.000	3.475,742	3.370,000	164,930	147.518,32	143.030,38	-4.487,94
SUMITOMO METAL	JPY	20.000	638,069	519,000	164,930	77.374,47	62.935,79	-14.438,68
SUMITOMO TITANIUM ORD	JPY	2.200	8.734,515	8.340,000	164,930	116.509,63	111.247,20	-5.262,43
SUMITOMO ELECTR.Industr.	JPY	11.100	1.887,920	1.777,000	164,930	127.059,45	119.594,37	-7.465,08
DAIKIN INDUSTRIES	JPY	7.400	5.542,732	6.260,000	164,930	248.688,64	280.870,67	32.182,03
DAITO TRUST COSTRUCTION	JPY	6.100	5.732,748	6.190,000	164,930	212.027,90	228.939,55	16.911,65
KDDI	JPY	26	773.988,584	832.000,000	164,930	122.013,60	131.158,67	9.145,07
TOKYO GAS	JPY	63.000	536,518	523,000	164,930	204.939,20	199.775,66	-5.163,54
TOSHIBA CORP	JPY	32.000	812,747	837,000	164,930	157.690,50	162.396,17	4.705,67
TOYOTA MOTOR CORP	JPY	4.400	7.647,260	6.040,000	164,930	204.013,47	161.135,03	-42.878,44
Nabtesco	JPY	10.000	1.952,201	1.778,000	164,930	118.365,40	107.803,31	-10.562,09
JAPAN TOBACCO	JPY	102	653.249,742	668.000,000	164,930	403.998,51	413.120,72	9.122,21
NINTENDO CO.	JPY	700	58.178,861	66.500,000	164,930	246.924,17	282.240,95	35.316,78
NOMURA HOLDINGS	JPY	7.000	2.361,953	1.895,000	164,930	100.246,60	80.428,06	-19.818,54
EAST JAPAN RAILWAY	JPY	25	896.222,331	922.000,000	164,930	135.848,90	139.756,25	3.907,36
HITACHI	JPY	18.000	775,328	833,000	164,930	84.617,15	90.911,30	6.294,15
MIZUHO FIN GROUP	JPY	22	727.325,982	534.000,000	164,930	97.017,96	71.230,22	-25.787,74
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL	JPY	20	1.161.124,929	837.000,000	164,930	140.802,15	101.497,61	-39.304,54
mitsui fudosan CO.LTD	JPY	7.000	3.004,256	2.430,000	164,930	127.507,36	103.134,66	-24.372,70

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

## SITUAZIONE TITOLI GESTORE PIONEER INVESTMENT MANAGEMENT SGR S.p.A.

(LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
MITSUBISHI CORP.	JPY	13.600	2.437,482	3.060,000	164,930	200.992,89	252.325,23	51.332,34
MITSUBISHI ELECTRIC	JPY	27.000	1.156,046	1.168,000	164,930	189.251,44	191.208,39	1.956,95
MITSUBISHI TOKYO FINL GR	JPY	11.800	1.243,144	1.047,000	164,930	88.941,40	74.908,14	-14.033,26
MITSUBISHI RAYON CO SHS	JPY	50.000	883,436	543,000	164,930	267.821,41	164.615,29	-103.206,12
YASKAWA ELEC ORD	JPY	10.000	1.513,742	1.524,000	164,930	91.780,88	92.402,84	621,96
UNI-CHARM	JPY	3.700	6.925,156	7.070,000	164,930	155.357,29	158.606,68	3.249,39
<b>AZIONARIO STATI UNITI</b>								
AMAG PHARMACEUTICALS ORD	USD	6.342	60,899	59,914	1,472	262.362,73	258.119,40	-4.243,33
ACTIVISION	USD	10.609	22,699	29,700	1,472	163.582,61	214.039,33	50.456,72
ALTRIA GROUP	USD	6.600	79,056	75,580	1,472	354.439,52	338.854,70	-15.584,82
AMERICAN INTERNATIONAL GROU	USD	13.102	60,239	58,300	1,472	536.139,57	518.882,28	-17.257,29
APACHE CORP.	USD	4.490	87,620	107,540	1,472	267.245,55	328.003,94	60.758,39
BRISTOL MYERS SQUIBB	USD	23.749	28,568	26,520	1,472	460.873,36	427.840,15	-33.033,21
CVS CORP	USD	21.347	37,519	39,750	1,472	544.067,46	576.416,85	32.349,39
CISCO SYSTEMS	USD	22.526	29,111	27,070	1,472	445.460,88	414.223,78	-31.237,10
CITIGROUP INC.	USD	28.081	30,736	29,350	1,472	586.296,68	559.865,06	-26.431,62
CITRIX SYSTEMS	USD	8.511	35,070	38,010	1,472	202.759,48	219.756,21	16.996,73
CONOCOPHILLIPS	USD	10.721	74,003	88,300	1,472	538.949,46	643.070,65	104.121,19
CORNING	USD	18.726	25,233	23,990	1,472	320.982,04	305.167,27	-15.814,77
Cubist Pharmaceuticl	USD	12.708	19,211	20,510	1,472	165.837,20	177.053,92	11.216,72
EBAY INC	USD	8.807	36,439	33,190	1,472	217.998,85	198.562,82	-19.436,03
EXELON	USD	12.511	76,283	81,640	1,472	648.307,29	693.837,40	45.530,11
FRANKLIN RESOURCES	USD	2.911	123,156	114,430	1,472	243.534,91	226.279,28	-17.255,63
GENERAL ELECTRIC	USD	14.914	40,370	37,070	1,472	408.996,09	375.560,07	-33.436,02
HESS ORD	USD	4.416	70,858	100,860	1,472	212.559,34	302.559,45	90.000,11
KRAFT FOODS	USD	17.545	32,810	32,630	1,472	391.041,48	388.895,69	-2.145,79
ESTEE LAUDER	USD	19.798	43,872	43,610	1,472	590.030,29	586.502,81	-3.527,48
LOWES CORP.- CAROLINA GROUP	USD	8.816	73,404	85,300	1,472	439.594,88	510.838,12	71.243,24
MARATHON OIL	USD	5.661	55,325	60,860	1,472	212.752,68	234.038,76	21.286,08
MERCK & CO INC	USD	21.524	49,283	58,110	1,472	720.585,59	849.643,12	129.057,53
MERRILL LYNCH	USD	10.070	55,587	53,680	1,472	380.248,40	367.201,68	-13.046,72
MICROSOFT CORP.	USD	33.574	34,942	35,600	1,472	796.914,64	811.924,73	15.010,09
MOSAIC ORD	USD	3.275	53,300	94,340	1,472	118.577,99	209.879,42	91.301,43
MOTOROLA	USD	36.575	17,550	16,040	1,472	436.046,89	398.521,16	-37.525,73
N.Y. COMMTY BANCORP	USD	32.401	17,753	17,580	1,472	390.743,03	386.936,74	-3.806,29
NEWMONT MINING	USD	14.789	46,754	48,830	1,472	469.702,53	490.555,58	20.853,05

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE PIONEER INVESTMENT MANAGEMENT SGR S.p.A.**

(LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
OCCIDENTAL PETROL.	USD	3.976	51,873	76,990	1,472	140.103,23	207.942,56	67.839,33
PROCTER & GAMBLE	USD	17.663	70,300	73,420	1,472	843.491,88	880.930,28	37.438,40
PUBL SVCS ENTERPR	USD	9.265	83,896	98,240	1,472	528.019,30	618.296,04	90.276,74
QUESTAR CORP	USD	11.005	50,782	54,100	1,472	379.633,03	404.436,18	24.803,15
SCHERING-PLOUGH	USD	33.198	28,269	26,640	1,472	637.498,66	600.770,82	-36.727,84
SOVEREIGN BANCORP.	USD	68.882	13,512	11,400	1,472	632.248,22	533.424,90	-98.823,32
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWA	USD	74.695	17,684	18,450	1,472	897.313,87	936.161,10	38.847,23
THOMAS&BETTS	USD	5.780	49,785	49,040	1,472	195.475,10	192.548,88	-2.926,22
TIME WARNER	USD	36.179	20,170	16,510	1,472	495.700,21	405.757,27	-89.942,94
TOLL BROTHERS	USD	13.410	21,975	20,060	1,472	200.179,25	182.735,27	-17.443,98
UNUMPROVIDENT	USD	22.575	22,918	23,790	1,472	351.446,12	364.825,25	13.379,13
VERIZON COMM	USD	19.849	42,906	43,690	1,472	578.527,40	589.092,32	10.564,92
VISTACARE-A	USD	19.530	9,509	7,250	1,472	126.151,04	96.184,02	-29.967,02
WAL-MART STORES	USD	14.876	48,413	47,530	1,472	489.224,64	480.304,52	-8.920,12
YAHOO INC	USD	19.722	27,738	23,260	1,472	371.607,15	311.618,58	-59.988,57
<b>TOTALE AZIONARIO</b>						<b>34.667.339,96</b>	<b>34.950.024,84</b>	<b>282.684,88</b>
<b>OBBLIGAZIONARIO</b>								
BTP 5% 01.05.1998/2008	EUR	4.560.000	101,570	100,304	1,000	4.631.584,77	4.573.862,40	-57.722,37
BTP 5,50% 01.11.1999/2010	EUR	205.000	105,520	103,400	1,000	216.316,00	211.970,00	-4.346,00
BTP 3% 15.04.04/09	EUR	4.500.000	98,545	98,654	1,000	4.434.525,01	4.439.430,00	4.904,99
BTP 3,50% 15.01.2003/2008	EUR	5.500.000	99,639	99,960	1,000	5.480.134,11	5.497.800,00	17.665,89
BTP-IFB08 2,75%	EUR	5.550.000	98,940	99,899	1,000	5.491.186,50	5.544.394,50	53.208,00
BTP3,50% 15.09.2003/2008	EUR	2.000.000	99,480	99,662	1,000	1.989.600,00	1.993.240,00	3.640,00
CCT TV 1.12.2010	EUR	4.535.000	100,530	100,340	1,000	4.559.035,50	4.550.419,00	-8.616,50
CCT TV 1.5.2004-2011	EUR	4.500.000	100,490	100,350	1,000	4.522.050,00	4.515.750,00	-6.300,00
CCT-1M212 IND	EUR	15.140.000	100,615	100,350	1,000	15.233.092,00	15.192.990,00	-40.102,00
CCT-1M214IND	EUR	5.000.000	100,615	100,400	1,000	5.030.750,11	5.020.000,00	-10.750,11
CCT-INV12 IND	EUR	14.555.000	100,572	100,360	1,000	14.638.208,31	14.607.398,00	-30.810,31
CCT-NV11 IND	EUR	15.100.000	100,529	100,340	1,000	15.179.864,00	15.151.340,00	-28.524,00
DEGV 3.000 03/14/08	EUR	5.000.000	99,596	99,840	1,000	4.979.808,28	4.992.000,00	12.191,72
DEGV 3.500 09/12/08	EUR	2.000.000	99,446	99,595	1,000	1.988.923,65	1.991.900,00	2.976,35
FRGV 3.500 09/12/08	EUR	8.000.000	99,525	99,559	1,000	7.961.980,68	7.964.720,00	2.739,32
<b>TOTALE OBBLIGAZIONARIO</b>						<b>96.337.058,92</b>	<b>96.247.213,90</b>	<b>-89.845,02</b>
<b>TOTALE GENERALE</b>						<b>131.004.398,88</b>	<b>131.197.238,74</b>	<b>192.839,86</b>

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE LCF ROTHSCHILD**

(LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
<b>AZIONARIO CANADESE</b>								
CDN NATURAL RES	CAD	5.000	62,150	72,580	1,445	215.066,79	251.159,25	36.092,46
<b>AZIONARIO AREA EURO</b>								
NESTLE'	CHF	2.000	431,668	520,000	1,655	521.748,07	628.512,72	106.764,65
<b>AZIONARIO AREA EURO</b>								
SOLARWORLD	EUR	15.000	24,857	41,750	1,000	372.856,20	626.250,00	253.393,80
BAY MOTOREN WERKE	EUR	17.500	45,902	42,730	1,000	803.280,12	747.775,00	-55.505,12
BEIERSDORF AG	EUR	11.000	55,697	52,870	1,000	612.670,44	581.570,00	-31.100,44
BAYER AG	EUR	14.000	56,994	62,370	1,000	797.918,75	873.180,00	75.261,25
SAP AG	EUR	15.000	40,976	35,620	1,000	614.643,58	534.300,00	-80.343,58
E.ON AG	EUR	8.000	103,290	145,610	1,000	826.320,00	1.164.880,00	338.560,00
BOLSAS Y MERCADOS	EUR	22.000	43,583	46,600	1,000	958.827,20	1.025.200,00	66.372,80
GAMESA SHS	EUR	15.000	31,125	31,980	1,000	466.871,48	479.700,00	12.828,52
NESTE OIL	EUR	20.000	22,729	24,130	1,000	454.574,12	482.600,00	28.025,88
GEOPHYSIQUE	EUR	2.050	162,157	195,000	1,000	332.420,97	399.750,00	67.329,03
TOTAL	EUR	11.000	53,670	56,830	1,000	590.375,04	625.130,00	34.754,96
VALLOUREC	EUR	3.000	220,300	185,150	1,000	660.900,00	555.450,00	-105.450,00
SUEZ	EUR	19.615	39,230	46,570	1,000	769.496,45	913.470,55	143.974,10
AXA SA	EUR	26.000	30,873	27,390	1,000	802.709,58	712.140,00	-90.569,58
DANONE GROUPE	EUR	8.000	59,000	61,400	1,000	471.998,14	491.200,00	19.201,86
PERNOD - RICARD	EUR	4.560	144,580	158,100	1,000	659.284,14	720.936,00	61.651,86
ESSILOR INTERNATIONAL	EUR	10.500	40,891	43,650	1,000	429.352,68	458.325,00	28.972,32
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	14.062	56,766	62,450	1,000	798.247,39	878.171,90	79.924,51
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	EUR	3.100	64,774	64,490	1,000	200.799,80	199.919,00	-880,80
ZODIAC	EUR	11.000	50,669	43,740	1,000	557.356,33	481.140,00	-76.216,33
VIVENDI UNIVERSAL	EUR	17.500	29,927	31,380	1,000	523.728,06	549.150,00	25.421,94
ROYAL DUTCH SHELL-A	EUR	13.500	26,160	28,750	1,000	353.162,92	388.125,00	34.962,08
UNICREDITO IT. ORD.	EUR	63.000	6,718	5,679	1,000	423.231,78	357.777,00	-65.454,78
ERG ORD.	EUR	35.000	15,155	12,878	1,000	530.421,44	450.730,00	-79.691,44

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE LCF ROTHSCHILD**

(LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
PIAGGIO	EUR	95.000	3,425	2,328	1,000	325.377,46	221.160,00	-104.217,46
UNILEVER NV	EUR	27.000	21,222	25,150	1,000	573.003,72	679.050,00	106.046,28
<b>AZIONARIO GRAN BRETAGNA</b>								
BG GROUP	GBP	26.000	6,930	11,500	0,733	245.694,42	407.718,01	162.023,59
GLAXOSMITHKLINE	GBP	30.000	13,305	12,790	0,733	544.293,68	523.215,38	-21.078,30
Aegis Group	GBP	280.000	1,406	1,250	0,733	536.791,14	477.261,88	-59.529,26
XSTRATA	GBP	8.000	34,421	35,500	0,733	375.493,45	387.263,93	11.770,48
KINGFISHER	GBP	173.200	2,383	1,456	0,733	562.796,35	343.872,91	-218.923,44
PREMIER OIL ORD	GBP	20.000	13,051	13,100	0,733	355.916,51	357.264,61	1.348,10
<b>AZIONARIO GIAPPONESE</b>								
KEYENCE CORP	JPY	3.500	26.113,553	27.570,000	164,930	554.158,94	585.066,39	30.907,45
SECOM CO.	JPY	13.000	6.170,000	6.110,000	164,930	486.327,53	481.598,25	-4.729,28
TOYOTA MOTOR CORP	JPY	15.000	7.960,000	6.040,000	164,930	723.943,49	549.323,96	-174.619,53
FANUC SHS	JPY	5.700	11.720,000	10.880,000	164,930	405.044,56	376.014,07	-29.030,49
<b>AZIONARIO STATI UNITI</b>								
AFFILIATED CMPTR-A	USD	12.500	51,949	45,100	1,472	441.116,28	382.956,32	-58.159,96
AMERICAN INTERNATIONAL GROU	USD	17.500	70,977	58,300	1,472	843.757,90	693.057,54	-150.700,36
APOLLO GROUP	USD	7.500	39,548	70,150	1,472	201.488,94	357.397,60	155.908,66
BEARINGPOINT	USD	65.000	7,485	2,830	1,472	330.476,90	124.957,54	-205.519,36
BRUNSWICK	USD	20.000	30,796	17,050	1,472	418.396,37	231.641,87	-186.754,50
CVS CORP	USD	26.000	31,007	39,750	1,472	547.635,01	702.058,28	154.423,27
CHEVRONTEXACO	USD	6.400	73,530	93,330	1,472	319.673,94	405.755,04	86.081,10
CONOCOPHILLIPS	USD	6.000	71,950	88,300	1,472	293.254,52	359.894,03	66.639,51
DEAN FOODS	USD	21.350	42,280	25,860	1,472	613.190,68	375.049,93	-238.140,75
GAP INC	USD	45.000	19,434	21,280	1,472	594.072,47	650.499,29	56.426,82
GENERAL ELECTRIC	USD	25.000	37,403	37,070	1,472	635.197,59	629.542,83	-5.654,76
GENERAL MILLS	USD	18.400	57,683	57,000	1,472	720.992,70	712.451,60	-8.541,10
HONEYWELL INTL	USD	14.000	45,139	61,570	1,472	429.278,65	585.544,46	156.265,81
JP MORGAN CHASE	USD	15.000	47,865	43,650	1,472	487.724,31	444.772,77	-42.951,54

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE LCF ROTHSCHILD**

(LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
JOHNSON & JOHNSON	USD	9.750	66,020	66,700	1,472	437.263,09	441.766,86	4.503,77
NEWS-A	USD	30.000	21,480	20,490	1,472	437.742,00	417.566,74	-20.175,26
PFIZER INC.	USD	25.000	23,110	22,730	1,472	392.467,02	386.013,18	-6.453,84
PITNEY BOWES	USD	14.000	46,504	38,040	1,472	442.265,00	361.768,90	-80.496,10
WYETH	USD	12.700	50,920	44,190	1,472	439.293,52	381.232,93	-58.060,59
XCEL ENERGY	USD	20.000	22,065	22,570	1,472	299.772,33	306.636,78	6.864,45
<b>TOTALE AZIONARIO</b>						<b>29.762.161,94</b>	<b>29.915.915,30</b>	<b>153.753,36</b>
<b>OBBLIGAZIONARIO</b>								
FORTIS BANK/ TV 20180214	EUR	1.000.000	99,772	99,770	1,000	997.718,60	997.700,00	-18,60
DPBG 3.478 11/04/15 '10 F	EUR	1.000.000	99,524	97,500	1,000	995.237,87	975.000,00	-20.237,87
BCO BILBAO TV 17.07.2013	EUR	1.000.000	100,425	99,458	1,000	1.004.250,00	994.575,00	-9.675,00
SANTAN CON FIN FLOAT 16	EUR	500.000	99,959	96,231	1,000	499.795,95	481.155,00	-18.640,95
BILBK3.556 03/01/16 '11 F	EUR	1.000.000	99,668	96,000	1,000	996.675,92	960.000,00	-36.675,92
CAIXAGALICIA	EUR	1.000.000	100,100	94,025	1,000	1.001.000,00	940.250,00	-60.750,00
CAJA DE MADRID FRN 03/2018	EUR	2.000.000	99,523	94,150	1,000	1.990.451,18	1.883.000,00	-107.451,18
BANCAJA TV 2009	EUR	2.000.000	100,035	96,900	1,000	2.000.703,60	1.938.000,00	-62.703,60
NATEXIS BP 16 FRN	EUR	2.000.000	99,924	96,159	1,000	1.998.485,88	1.923.180,00	-75.305,88
CCMSO3.436 02/22/16 '11 M	EUR	1.000.000	99,784	97,050	1,000	997.837,90	970.500,00	-27.337,90
LAPST12/12/16 '11 M	EUR	2.000.000	99,980	95,651	1,000	1.999.591,91	1.913.020,00	-86.571,91
CCMSO05/21/17 '12 M	EUR	500.000	99,915	95,240	1,000	499.572,90	476.200,00	-23.372,90
OTTOG07/11/14 FRN	EUR	2.000.000	99,886	99,880	1,000	1.997.725,08	1.997.600,00	-125,08
ATAC TV 28.02.2008	EUR	477.000	100,151	99,900	1,000	477.720,36	476.523,00	-1.197,36
ROYAL BK SCOTLAND TV 03/13	EUR	2.000.000	100,565	100,140	1,000	2.011.300,00	2.002.800,00	-8.500,00
BCO POP.VR NO TV 17.10.08	EUR	1.000.000	100,060	100,033	1,000	1.000.600,00	1.000.330,00	-270,00
MPS TV 18.12.2008	EUR	2.000.000	100,163	99,930	1,000	2.003.259,73	1.998.603,00	-4.656,73
COFINOGA TV 09	EUR	2.000.000	100,253	100,155	1,000	2.005.063,94	2.003.100,00	-1.963,94
BFCM TV 11	EUR	1.000.000	100,178	99,455	1,000	1.001.777,00	994.550,00	-7.227,00
SOC GEN TV 15.3.16	EUR	2.000.000	100,791	97,520	1,000	2.015.818,20	1.950.400,00	-65.418,20
NORDEA BK TV 25.03.2014	EUR	2.000.000	100,429	99,190	1,000	2.008.575,74	1.983.800,00	-24.775,74

## XVI LEGISLATURA – DISEGNI DI LEGGE E RELAZIONI - DOCUMENTI

**SITUAZIONE TITOLI GESTORE LCF ROTHSCHILD**

(LINEA BILANCIATA INTERNAZIONALE)

Descrizione	Div.	Quantità/ Valore Nominale	Prezzo medio di carico	Prezzo di mercato al 31/12/2007	Cambio al 31/12/07	Controvalore di carico in Euro	Controvalore di mercato in Euro	Plus / Minusvalenza
MERRILL LYNCH TV 22.03.2011	EUR	1.000.000	100,786	95,888	1,000	1.007.864,10	958.880,00	-48.984,10
INTL LEASE 08 FRN	EUR	2.000.000	100,555	99,835	1,000	2.011.100,00	1.996.700,00	-14.400,00
SANTANDER ISS TV 2014	EUR	1.000.000	100,239	98,520	1,000	1.002.392,93	985.200,00	-17.192,93
SKANDI ENSK 14 FRN	EUR	1.600.000	100,254	98,350	1,000	1.604.065,43	1.573.600,00	-30.465,43
DEUTSCHE 09 FRN	EUR	1.000.000	100,109	99,935	1,000	1.001.089,91	999.350,00	-1.739,91
UNICREDITO 15 FRN	EUR	1.000.000	100,235	97,215	1,000	1.002.350,00	972.150,00	-30.200,00
AAB 15 FRN	EUR	2.000.000	98,924	97,000	1,000	1.978.475,74	1.940.000,00	-38.475,74
BK OF IRELAND 17FRN	EUR	2.000.000	100,351	96,395	1,000	2.007.024,48	1.927.900,00	-79.124,48
Depfa Bk 15 FRN	EUR	1.500.000	99,780	94,997	1,000	1.496.692,53	1.424.955,00	-71.737,53
DB 15 FRN (NO MIN.) EURO ME	EUR	1.500.000	99,929	98,100	1,000	1.498.934,87	1.471.500,00	-27.434,87
HSBC BK 20 FRN	EUR	2.000.000	100,278	92,495	1,000	2.005.558,43	1.849.900,00	-155.658,43
BCA POPOLARE 12 FRN	EUR	1.000.000	99,627	98,304	1,000	996.272,56	983.040,00	-13.232,56
JPM CHASE 15 FRN	EUR	1.000.000	100,226	92,820	1,000	1.002.255,80	928.200,00	-74.055,80
ALLIED IRISH 17 FRN	EUR	1.000.000	99,895	94,705	1,000	998.954,13	947.050,00	-51.904,13
BCA INTESA 15 FRN	EUR	2.000.000	99,906	97,955	1,000	1.998.127,65	1.959.100,00	-39.027,65
UBS AG 15 FRN	EUR	1.000.000	100,049	96,500	1,000	1.000.492,93	965.000,00	-35.492,93
BARCLAY'S BK PLC BACR FLOAT	EUR	1.500.000	99,862	95,730	1,000	1.497.931,39	1.435.950,00	-61.981,39
FINDOMESTIC TV 1/16	EUR	1.000.000	99,964	97,775	1,000	999.640,93	977.750,00	-21.890,93
IBSANP FLOAT 18	EUR	2.000.000	99,646	95,000	1,000	1.992.919,81	1.900.000,00	-92.919,81
BANCA POP MILANO FLOAT 11	EUR	1.000.000	99,949	99,600	1,000	999.485,86	996.000,00	-3.485,86
SANTANDER ISSUAN	EUR	1.500.000	99,650	96,250	1,000	1.494.750,00	1.443.750,00	-51.000,00
FRN 01 MAR 2006 - 2013 EMTN	EUR	2.000.000	100,060	94,984	1,000	2.001.200,00	1.899.680,00	-101.520,00
GE CAPITAL EUROPEA	EUR	1.500.000	99,345	93,425	1,000	1.490.176,78	1.401.375,00	-88.801,78
BP VERONA/TV MTN 20160615	EUR	1.000.000	99,974	96,500	1,000	999.736,44	965.000,00	-34.736,44
BCA CARIGE SPA	EUR	1.000.000	99,889	96,455	1,000	998.889,87	964.550,00	-34.339,87
FTE3.224 06/09/10 FRN M	EUR	1.000.000	100,173	99,193	1,000	1.001.734,81	991.930,00	-9.804,81
LEH 06/12/13 FRN MTN	EUR	1.500.000	99,987	92,890	1,000	1.499.806,85	1.393.350,00	-106.456,85
ANGLO IRISH BK CP	EUR	1.000.000	100,048	88,610	1,000	1.000.482,80	886.100,00	-114.382,80
C3.161 06/28/13 FRN M	EUR	1.000.000	100,113	96,254	1,000	1.001.131,30	962.535,00	-38.596,30