

**PATRIMONIO IMMOBILIARE
DELL'ENTE**

PAGINA BIANCA

N°	DESCRIZIONE IMMOBILE	Anno di acquisto	Prezzo di acquisto
A) Fabbricati ad uso della Fondazione			
1	ROMA - Via Torino, 38 - Sede Ente	64	464.811,21
2	ROMA - Via Torino, 40 - Uffici	77	885.723,58
3	ROMA - Via Greppi, 85/Via Mengarini - Magazzino	85	299.545,00
	Totale A)		1.650.079,79
B) Fabbricati ad uso terzi			
1	ROMA - Via Emilio de' Cavalieri, 12 - intt. 2-3-7	56-57	26.132,72
2	ROMA - Via Crescenzo del Monte, 26 - Sc. A e Via F. Chiappini	58	101.225,55
3	ROMA - Via Flaminia, 53 - Via degli Scialoja, 3	58	387.342,67
4	ROMA - Via del Melone, 16/20	60	154.937,07
5	ROMA - Via Caio Lelio, 28	59	80.050,82
6	ROMA - Via Giuseppe Perrucchetti, 14	59	61.974,83
7	ROMA - P.za Cola di Rienzo, 80/a	59-61	63.524,20
8	ROMA - Via Statilio Ottato, 9/25	60	226.208,12
9	ROMA - Via Rosa Guarnieri Carducci, 9	61	180.759,91
10	ROMA - Via degli Estensi, 91/93 e residua area ...	61	31.260,10
11	ROMA - Via Ugo de' Carolis, 93	61	180.759,91
12	ROMA - Via Luigi Corti, 13	61	48.288,72
13	ROMA - Via Portuense (Villa Flora) n. 6 pal. e area edificanda	62	224.147,46
14	ROMA - Via Tiburtina, 612	62	377.013,54
15	ROMA - Via Attilio Friggeri, 131	62	192.638,42
16	ROMA - Via Rosa Guarnieri Carducci, 13	62	258.228,45
17	ROMA - Via Attilio Friggeri, 172	62	242.734,74
18	ROMA - Via Raimondi Garibaldi, 77 e 93	63	384.760,39
19	ROMA - Via Licinio Murena, 12/Viale dei Consoli, 11	63	556.337,70
20	ROMA - Via Carlo Fadda, 23 e 25	63	266.491,76
21	ROMA - Via Francesco Grimaldi, 64	63	323.818,48
22	ROMA - Via G. de' Leva, 37 - Via Cessati Spiriti, 4	64	418.330,09
23	ROMA - Via Luigi Corti, 7	59	41.316,55
24	ROMA - Via Marco Celio Rufo, 12	65	550.026,60
25	ROMA - Via Nocera Umbra, 62 - Via Fonti del Clitunno, 25	67	748.862,50
26	ROMA - Via San Romano, 15	67	410.583,23
27	ROMA - Via G. Ricci Curbastro, 29	68	431.241,51
28	ROMA - Autorimessa Via R.R. Garibaldi, 99/A	69	103.291,38
29	ROMA - Via Pienza, 4/299	72	3.253.678,46
30	ROMA - Via Suvereto, 10/30 - Via Gualterio, 116/122	72	1.910.890,53
31	ROMA - Via Vaglia, 38 - Via Montaione, 33/41	73	2.051.883,26
32	ROMA - Via Vaglia, 25/37/65 - Via Cinigiano, 8/32	73	2.205.270,96
33	ROMA - Piazza Vinci, 44/49 - Supermercato	78	531.950,61
34	ROMA - Via delle Vigne, 80	79	2.117.473,29
35	ROMA - Via Bosco degli Arvali, 131/169	79	1.755.953,46
36	ROMA - Via Cina, 40	83	11.362.051,78
37	ROMA - Via Grotte di Gregna, 121/137/153	84	9.812.681,08
38	ROMA - Via Eudo Giulio, 3/35	84	16.526.620,77
39	ROMA - Via Canton, 49	84	4.699.757,78
40	ROMA - Via Fosso del Torrino, 45	84	3.847.603,90
41	ROMA - Via Libero Leonardi, 120	85	11.103.823,33
42	ROMA - Via Pescosolido, 16-18-26-140-154-168-180-192	85	12.394.965,58
43	ROMA - Via Carlo Spegazzini, 73 - Via G.A. Cortuso, 40	85	9.967.618,15
44	ROMA - Via G. Bucco, 12/40 - Via P. Gennari, 81	86	5.939.254,34
45	ROMA - Via Luigi Gadola, 20	86	6.972.168,14

Valori rideterminati come da bilancio consuntivo '97	Decrementi per dismissioni	Incrementi 1998-2010 e/o acquisizioni	Incrementi 2011	Valori di Bilancio al 31/12/2011
7.749.765,62		391.144,37		8.140.909,99
4.015.106,04		79.104,88		4.094.210,92
342.240,49		73.705,17		415.945,66
12.107.112,15		543.954,42	0,00	12.651.066,57
919.809,74		0,00		919.809,74
2.930.988,65		43,95		2.931.032,60
10.947.086,82		436.346,23		11.383.433,05
3.754.479,80		0,00		3.754.479,80
4.340.060,22		96,83		4.340.157,05
2.563.815,17		22.726,09		2.586.541,26
796.388,58		0,00		796.388,58
10.615.543,91		96,83		10.615.640,74
6.514.392,00		140,78		6.514.532,78
2.441.010,13		140,78		2.441.150,91
5.422.207,54		26.139,28		5.448.346,82
1.675.892,31		8.338,86		1.684.231,17
10.580.657,66		73.979,65		10.654.637,31
12.113.720,61		96,83		12.113.817,44
3.949.161,02		15.555,54		3.964.716,56
7.081.471,70		140,77		7.081.612,47
5.182.601,70		11.960,91		5.194.562,61
8.648.055,07		4.115,65		8.652.170,72
15.407.453,20		44.781,91		15.452.235,11
8.085.649,21		157,16		8.085.806,37
9.129.467,69		83.187,04		9.212.654,73
8.115.931,66		96,84		8.116.028,50
1.719.775,65		13.512,98		1.733.288,63
10.835.284,65		96,83		10.835.381,48
14.477.292,53		96,83		14.477.389,36
8.405.062,31		96,83		8.405.159,14
9.296.224,18		140,78		9.296.364,96
108.703,95		0,00		108.703,95
38.217.810,53		5.035,86		38.222.846,39
20.744.715,35		10.468,60		20.755.183,95
21.676.852,92		4.529,33		21.681.382,25
20.126.888,30		4.529,33		20.131.417,63
1.561.509,09		0,00		1.561.509,09
9.344.623,94		140,78		9.344.764,72
13.634.126,44		292.139,19		13.926.265,63
11.617.920,43		201,10		11.618.121,53
23.385.087,72		73.928,48		23.459.016,20
14.219.489,02		52.233,77		14.271.722,79
7.117.385,49		201,10		7.117.586,59
4.009.884,10		201,10		4.010.085,20
15.215.140,45		6.789,13		15.221.929,58
21.562.126,56		96,84		21.562.223,40
10.248.720,00		4.469,01		10.253.189,01
7.275.214,72		4.469,01		7.279.683,73
14.016.480,14		1.552,17		14.018.032,31

N°	DESCRIZIONE IMMOBILE	Anno di acquisto	Prezzo di acquisto
46	ROMA - Via Cina, 330	86	10.639.012,12
47	ROMA - Via Francesco Tovaglieri, 185	86	6.145.837,10
48	ROMA - Via Patrizio Gennari, 61/67/76	87	3.511.906,91
49	ROMA - Via Domenico Sansotta, 97 (Uffici)	87	11.413.697,47
50	ROMA - Via Fiume delle Perle, 186/188	87	5.371.151,75
51	ROMA - Via Arnaldo Foschini, 10/20	87	4.157.478,04
52	ROMA - Via Raimondo d'Aronco, 18	87	9.812.681,08
53	ROMA - Via di Torre Gaia, 122/124	88	6.579.660,89
54	ROMA - Via Mar della Cina, 266 (Uffici)	89	4.389.883,64
55	ROMA - Piazza Militari caduti nei lager , 31/57 ex Via di Tor Pagnotta	90	7.127.105,21
56	ROMA - Via Roccaraso 9/13 - Supermercato	90	4.080.009,50
57	ROMA - Via delle Costellazioni, 300	91	6.197.482,79
58	ROMA - Via della Grande Muraglia 46 (ex Comp.Z9-Edificio "D")	92	8.908.881,51
59	ROMA - Via Agostino Magliani, 9/13 (Comp. MONTECERVINO)	92	10.845.594,88
60	ROMA - P.za G.Marconi, 25 "Grattacielo Italia" - Uffici	73	5.681.025,89
61	ROMA - V.le Oceano Pacifico, 171 - Complesso Uffici IBM	74	5.396.974,60
62	ROMA - Via Suvereto, 230/250 -Via Chiala, 125 - Compl. Res.le	76	4.209.123,73
63	ROMA - Complesso immobiliare Loc. "Fontana Candida"	83	11.775.217,30
64	ROMA - Via Igino Giordani, 104 - Uffici	83	3.202.032,77
65	ROMA - Via Barberini, 3 e 11 - Uffici	83	40.283.638,13
66	ROMA - CINECITTA' DUE Ed. U2 - Via Lamaro, 25/39	86	28.611.712,21
67	ROMA - CINECITTA DUE Ed. U3,1 - Via Lamaro, 13/21	86	20.193.464,75
68	LATINA - P.le Gorizia, 19 - 23 - L.go Giovanni XXIII, 3 - 13	65	593.925,43
69	LATINA - Via Eroi del Lavoro, 17	69	134.278,79
70	MILANO - Via Filippo Turati, 29	64	542.279,74
71	MILANO - Via G.Forni, 72/74	64	712.710,52
72	MILANO - Via Sulmona, 23	68	1.807.599,15
73	MILANO - Via Lorenzo Valla, 25	66	826.331,04
74	MILANO - Via Manzoni angolo Via Montenapoleone, 29	68	320.203,28
75	MILANO - Via Sulmona, 11 - Via Tertulliano	69	1.688.814,06
76	MILANO - C.so Como, 15/Via di Tocqueville - Compl. Comm. e Res."First Residence"	70	2.978.142,52
77	MILANO - P.za Borromeo (Parcheggio sotterraneo)	76	4.751.403,47
78	MILANO - VIMODRONE - Quart."Mediolanum" - Via XI Martiri, 2	74	6.274.951,32
79	MILANO - Via Ripamonti, 42/V.le Toscana	86	15.751.935,42
80	MILANO - Via Bordonì, 8/10	87	4.389.883,64
81	MILANO - BASIGLIO - Residenza "IL SOLCO"	84	11.702.913,33
82	MILANO - BASIGLIO - Residenza "RIO NUOVO" Edif. (31/3)	88	6.042.545,72
83	MILANO - BASIGLIO - Residenza "RIO NUOVO" Edif. (31/2)	89	8.624.830,21
84	MILANO - Via Montegrappa, 3/5 - Via Melchiorre Gioia	78	17.043.077,67
85	MILANO - V.le Brenta, 27/29	81	16.913.963,45
86	MILANO - Via Meravigli, 12/14 - Via Camperio, 1/5	80	38.217.810,53
87	MILANO - Via Lampedusa, 13	76	12.911.422,48
88	MILANO - Via Toffetti, 121	76	4.648.112,09
89	MILANO - Via Cavriana, 14	75	5.164.568,99
90	MILANO - Via Medici del Vascello, 14/26	75	17.301.306,12

Valori rideterminati come da bilancio consuntivo '97	Decrementi per dismissioni	Incrementi 1998-2010 e/o acquisizioni	Incrementi 2011	Valori di Bilancio al 31/12/2011
9.663.793,89		383,72		9.664.177,61
10.327.942,38		2.007,07		10.329.949,45
4.262.876,56		0,00		4.262.876,56
18.596.319,21		140,78		18.596.459,99
4.427.399,07		201,10		4.427.600,17
4.278.197,92		5.271,72		4.283.469,64
10.075.142,64		0,00		10.075.142,64
7.127.494,86		33.831,64		7.161.326,50
3.428.421,66		0,00		3.428.421,66
9.495.060,09		0,00		9.495.060,09
1.576.502,35		0,00		1.576.502,35
7.398.018,79		0,00		7.398.018,79
8.908.881,51		393.224,64		9.302.106,15
10.845.594,88		494.439,19		11.340.034,07
24.126.800,50		2.344.123,44		26.470.923,94
15.349.785,93		0,00	7.939.934,81	23.289.720,74
27.604.652,24		4.529,34		27.609.181,58
23.681.227,31		120.880,52		23.802.107,83
6.916.878,84		267.317,23		7.184.196,07
40.283.638,13		4.413.475,41		44.697.113,54
29.011.584,87		67.155,14		29.078.740,01
18.169.656,26		298.429,99		18.468.086,25
8.644.928,86		13.082,83		8.658.011,69
1.694.484,55		11.333,93		1.705.818,48
5.263.934,30		53.263,15		5.317.197,45
5.748.438,49		87.165,49		5.835.603,98
21.025.865,97		235.743,79		21.261.609,76
5.470.252,39		109.939,74		5.580.192,13
2.563.855,66		2.326,15		2.566.181,81
18.328.946,89		159.849,78		18.488.796,67
10.950.131,00		7.272.143,97		18.222.274,97
9.915.972,46		1.443.623,67		11.359.596,13
31.198.541,53		104.762,93		31.303.304,46
15.364.592,75		7.416,57		15.372.009,32
5.199.912,06		10.286,28		5.210.198,34
12.859.394,61		358.919,88		13.218.314,49
3.773.884,84		152.851,28		3.926.736,12
5.020.162,48		185.186,96		5.205.349,44
40.515.010,82		1.920.108,38		42.435.119,20
15.852.644,52		461.424,33		16.314.068,85
42.751.145,14		5.518.032,87		48.269.178,01
56.845.403,79		1.046.867,22		57.892.271,01
9.861.257,92		526.760,91		10.388.018,83
16.889.502,11		843.486,61		17.732.988,72
43.229.399,83	10.900.523,11	3.978.799,33		36.307.676,05

N°	DESCRIZIONE IMMOBILE	Anno di acquisto	Prezzo di acquisto
91	MILANO - Via Viviani, 10/12 - Via Bordonì, 4/6	77	11.697.748,76
92	MILANO - Via Viviani, 8 - Via Adda, 11 - Via Cornalia, 11	77	
93	MILANO - Via Roncaglia, 8 - Uffici	78	
94	MILANO - Via Costanza, 12/19-Via Gessi, 8-Via Leto, 3/5 - Uffici	78	13.744.983,91
95	MILANO - Via Villorosi, 11/13/15 - Uffici	78	
96	MILANO - Via Cavriana, 20 - Uffici	86	33.569.698,44
97	MILANO - Via Lampedusa, 11/A - Uffici	86	42.583.978,47
98	MILANO - Via Bordonì, 2 - Uffici	86	7.150.862,22
99	MILANO - Via Bordonì, 12 - Abitazioni	86	2.778.021,66
100	MILANO - Via Cornalia, 7/9	86	8.428.576,60
101	MILANO - Via Lorenteggio, 257 - Uffici / Magazzini / Usi diversi	86	173.013.061,19
102	SEGRATE (MI) - Compr. "Milano Oltre" Ed. "Donatello"	89	2.494.486,82
103	SEGRATE (MI) - Compr. "Milano Oltre" Ed. "Raffaello" Sc. A - V.Cassanese	90	5.784.317,27
104	SEGRATE (MI) - Centro Dir.le "Milano Oltre" "PALAZZO TIGLI" Sc. B	91	9.115.464,27
105	ASSAGO (MI) - Località "MILANOFIORI" - Uffici	80	9.554.452,63
106	CORSICO (MI) - Via di Vittorio, 32 - Uffici	81	59.392.543,40
107	CUSAGO (MI) - V.le Europa, 50 - Magazzino	85	26.112.060,82
108	MONTEGROTTO TERME (PD) - Alb. "Montecarlo" - V.le Stazione	74	908.964,14
109	MONTEGROTTO TERME (PD) - Alb. Termale "Caesar" - Via Aureliana	79	3.098.741,39
110	ABANO TERME (PD) - Grand Hotel "Orologio"	83	24.273.474,26
111	FIRENZE - Via Piagentina, 25/27	73	542.279,74
112	PISA - Via San Michele degli Scalzi/Via Cuppari - Abitazioni	86	36.771.731,22
113	LA THUILE (AO) - Lotto "Le Suches" - Ristorante	82	103.136.442,75
114	LA THUILE (AO) - Lotto "E" - Residence	82	
115	LA THUILE (AO) - Lotti "H-IL" - Albergo	82	
"	LA THUILE (AO) - Lotto "F" - Residence	82	
116	LA THUILE (AO) - Lotto "G"	82	
"	LA THUILE (AO) - Lotto "O" - Residence	82	
"	LA THUILE (AO) - Lotto "CS" - Centro Sportivo	82	
117	GENOVA - Centro Direz. di S.Benigno - Torre di Francia - Via di Francia	91	14.512.438,86
	TOTALE B)		1.100.066.842,90

Valori rideterminati come da bilancio consuntivo '97	Decrementi per dismissioni	Incrementi 1998-2010 e/o acquisizioni	Incrementi 2011	Valori di Bilancio al 31/12/2011
22.740.423,60		99.336,02		22.839.759,62
13.092.997,67		43.908,58		13.136.906,25
8.926.957,50		0,00		8.926.957,50
6.064.112,96		847.814,48		6.911.927,44
8.059.836,70		347.378,79		8.407.215,49
30.047.591,50		15.311,45		30.062.902,95
37.919.297,82		7.995.696,66		45.914.994,48
12.433.849,07		0,00		12.433.849,07
2.451.162,48		0,00		2.451.162,48
7.896.442,61		0,00		7.896.442,61
140.528.309,58		3.573.815,89		144.102.125,47
793.611,22		0,00		793.611,22
2.985.734,72		0,00		2.985.734,72
10.887.172,53		1.216,10		10.888.388,63
13.216.305,47		893.693,87		14.109.999,34
34.970.353,41		11.574.317,85		46.544.671,26
33.904.273,41		1.895.652,55		35.799.925,96
5.258.523,00		850.374,97		6.108.897,97
5.616.668,90		465.979,82		6.082.648,72
38.651.841,15		1.542.522,84		40.194.363,99
4.531.236,66		1.379,87		4.532.616,53
35.909.568,28		617.687,26		36.527.255,54
{		0,00		0,00
		0,00		0,00
		0,00		0,00
	121.374.069,66	13.519.042,59		134.893.112,25
		0,00		0,00
		0,00		0,00
		0,00		0,00
15.964.786,42		0,00		15.964.786,42
1.738.780.822,04	10.900.523,11	78.436.987,55	7.939.934,81	1.814.257.221,29

N°	DESCRIZIONE IMMOBILE	Anno di acquisto	Prezzo di acquisto
	C) Immobili dati in Usufrutto		
1	ROMA - Piazza Poli, 7/Via del Mortaro, 19 - "Hotel delle Nazioni"	74/06	19.238.286,56
2	ROMA - Via Cavour, 33 - Via Principe Amedeo 9c-11c "Albergo Genova"	74	1.446.079,32
3	ROMA - P.le Appio, 7 - Complesso Commerciale COIN	74	2.158.789,84
4	ROMA - Via della Nocetta - "Hotel Villa Pamphili"	76	4.790.137,74
5	ROMA - Largo Febo, 2 (Hotel "Raphael")	63	338.279,27
6	MILANO - Via Don Sturzo, 45 - Hotel "Executive"	81	40.283.638,13
7	MILANO - Via Trivulzio, 6/8 - Via Parmigianino, 13/15 - "Hotel De Angeli"	86	11.935.318,94
8	SEGRATE (MI) - Via Fratelli Cervi - Residence e Albergo	78	16.397.506,55
9	PIEVE EMANUELE (MI) - V.le dei Pini, 3 - Residence Ripamonti	80	35.119.069,14
10	PIEVE EMANUELE (MI) - V.le dei Pini, 1 - Compl. Alberg. e C.Sportivo	83	22.724.103,56
11	MONTEGROTTO TERME (PD) - Alb.Termale "Des Bains" - V. Mezzavia	74	1.198.180,01
12	ABANO TERME (PD) - Alb. Termale "Magnolia" - Via Volta, 6	79	6.455.711,24
13	VILLASIMIUS (CA) - Complesso Turistico Alberghiero	74	5.835.962,96
14	MILANO - Via Tocqueville, 7/D/C.so Como, 15 (UNA HOTEL)	70	378.827,32
15	MILANO - Via Lampedusa, 11/A - (Hotel Quark)	86	52.444.090,96
16	MILANO - C.so di Porta Romana, 64 - Via A.Calimero, 3	72	929.622,42
17	MILANO - Via Cornalia, 7/9 "Hotel Class"	86	4.741.074,33
	TOTALE C)		220.743.981,54
	D) Terreni Edificabili		
1	MILANO - Area edificabile - Via di Lorenteggio	95	9.296,22
	TOTALE D)		9.296,22
	E) Migliorie - Opere in corso di esecuzione		
	F) Fabbricati in corso di costruzione		
1	ROMA - P.zza Vittorio		
	TOTALE F)		
	G) Unità Immobiliari		
	TOTALE G)		
	TOTALE IMMOBILI (A+B+C+D+E+F+G)		

Valori rideterminati come da bilancio consuntivo '97	Decrementi per dismissioni	Incrementi 1998-2010 e/o acquisizioni	Incrementi 2011	Valori di Bilancio al 31/12/2011
5.343.999,55		17.998.790,00		23.342.789,55
7.580.141,20		0,00		7.580.141,20
11.707.528,08		3.098.896,33		14.806.424,41
23.877.444,78		1.454.248,29		25.331.693,07
3.107.857,89		0,00		3.107.857,89
52.164.888,88		4.422.214,60		56.587.103,48
10.302.345,83		1.093.353,91		11.395.699,74
29.766.322,17		2.892.141,74		32.658.463,91
49.511.662,79		3.840.300,04		53.351.962,83
24.747.536,29		5.066.407,96		29.813.944,25
4.106.154,71		1.477.544,76		5.583.699,47
12.487.613,92		5.480.611,17		17.968.225,09
35.117.671,06		7.541.066,52		42.658.737,58
1.586.475,03				1.586.475,03
56.546.387,49		131.659,38		56.678.046,87
10.845.594,88		77.880,80		10.923.475,68
4.441.748,97		0,00		4.441.748,97
343.241.373,52		54.575.115,50	0,00	397.816.489,02
9.296,22		0,00		9.296,22
9.296,22		0,00		9.296,22
				5.395.047,07
				151.443.591,99
				151.443.591,99
				0,00
				2.381.572.712,16

**IMMOBILIZZAZIONI
FINANZIARIE**

PAGINA BIANCA

Isin	Investimento	Valore nominale	Costo d'acquisto (in euro per i titoli USD)
IT0000784196	BANCA POPOLARE DI SONDRIO	134.400	5,95
IT0004618465	ENEL GREEN POWER	62.500.000	1,60
TOTALE AZIONI			
IT0001247409	BTPS 27-07-1998 / 01-11-27	23.625.000	37,47
IT0001312781	BTPS 09-11-98 / 01-05-28	23.625.000	36,80
IT0001312799	BTPS 18-11-98 / 01-11-28	23.625.000	36,24
IT0001312807	BTPS 18-11-98 / 01-05-29	23.625.000	35,76
IT0001312815	BTPS 18-11-98 / 01-11-29	23.625.000	35,32
IT0001312773	BTPS 18-11-98 / 01-11-29	627.500.000	35,80
IT0004656275	BTP 3% 1/11/2015	500.000.000	99,01
TOTALE TITOLI EMESSI O GARANTITI DALLO STATO		1.245.625.000	
XS0146060842	ABN AMRO BANK DIVIDEND DAX/DAX 05/04/2022	15.000.000	100,00
XS0261262157	ABN AMRO Reverse Coupon Note Linked basket 26/07/2022	70.000.000	100,00
XS0187695225	ABN AMRO SELECT DIVIDEND DJ EUROSTOXX 20/03/2017	10.000.000	100,00
XS0338352213	ART 5 Series 152 Hedge Fund Performance linked Notes 20/06/2023	100.000.000	100,00
XS0338352304	ART 5 Series 153 Alternative Asset Performance linked Notes 20/06/2023	30.000.000	100,00
IT0003950828	BANCA NUOVA INFLAZIONE EUROPEA E CMS LINKED 10/11/2015	10.000.000	100,00
IT0004148968	BANCA NUOVA MEMORY TECHNOLOGICAL STOCKS LINKED 20/11/2013	10.000.000	100,00
IT0004193758	BANCA NUOVA S.p.A. 86.a emissione MEMORY 10Y 2007 - 2017	10.000.000	100,00
IT0003754170	BANCA POPOLARE DI VICENZA 2004/14 INFLAZIONE EUROPEA CMS LINKED	10.000.000	100,00
XS0345444508	BANCO ESPANOL DE CREDITO 8Y Livestock Revolution Index Note 11/02/2016	15.000.000	100,00
XS0273484088	BANCO ESPANOL DE CREDITO Range Accrual 15Y linked to GBP10Y CMS EUR10Y CMS 06/11/2021	10.000.000	100,00
XS0126129666	BANQUE ET CAISSE D'EPARGNE DE L'ETAT- LUXEMBOURG SU LOWER TIER 2001/16	25.000.000	100,00
XS0335455928	BARCLAYS 6Y COMMODITIES 11/12/2013	20.000.000	100,00
XS0201293445	BARCLAYS BANK – 8 YEAR SAPHIR PROTECTED NOTE ON A BASKET OF 6 INDICES 28/09/2012	15.000.000	100,00
XS0243916128	BARCLAYS BANK 9Y EUR PRINCIPAL PROTECTED NOTE linked to the DFD Innohedge Fund 27/02/2015	20.000.000	100,00
XS0342786281	BARCLAYS BANK PLC 10Y SAPHIR NOTE 29/01/2018	20.000.000	100,00
XS0285465307	BARCLAYS BANK PLC 12Y EUR Principal Protected Note linked to Income Plus (EUR) Index 08/02/2019	5.000.000	100,00
XS0294148829	BARCLAYS BANK PLC 12Y EUR Principal Protected Note linked to Income Plus (EUR) Index 08/04/2019	5.000.000	100,00
XS0285465729	BARCLAYS BANK PLC 12Y USD Principal Protected Note linked to Income Plus (USD) Index 08/02/2019	5.000.000	77,32
XS0342638680	BARCLAYS BANK PLC 14% Saphir (2008) Guaranteed Note with Lock in 01/02/2018	25.000.000	100,00
XS0209040970	BEAR STEARNS CMS SPREAD NOTE 5.1.2020	20.000.000	99,50
XS0287598279	BNP PARIBAS 10Y Driver on Stocks Basket (EUR) 100% Capital protected 20/02/2017	10.000.000	100,00
XS0166881424	BNP PARIBAS 5,25% 16.4.2013	10.000.000	99,25
XS0334987566	BNP PARIBAS 5Y MILLENNIUM ER CERTIFICATE 13/12/2012	20.000.000	100,00
XS0369565188	BNP PARIBAS Arbitrage Issuance BV capped certificate on Commodity Basket 18/06/2013	20.000.000	100,00

Valore al costo d'acquisto	Quotazione 31/12/2011 (in euro per i titoli USD)	Valore di mercato 31/12/2011	Fondo oscillazione titoli mobiliari e fondo oscillazione cambi	Valore di bilancio 31/12/2011
799.350,00	6,145	825.888,00		799.350,00
100.000.000,00	1,609	100.562.500,00		100.000.000,00
100.799.350,00		101.388.388,00		100.799.350,00
8.852.288,00	32,097	7.582.916,25		8.852.288,00
8.694.000,00	31,172	7.364.385,00		8.694.000,00
8.562.409,00	30,357	7.171.841,25		8.562.409,00
8.449.009,00	29,591	6.990.873,75		8.449.009,00
8.344.350,00	29,005	6.852.431,25		8.344.350,00
224.626.175,00	29,613	185.821.575,00		224.626.175,00
495.050.000,00	90,805	454.025.000,00		495.050.000,00
762.578.231,00		675.809.022,50		762.578.231,00
15.000.000,00	75,750	11.362.500,00		15.000.000,00
70.000.000,00	63,850	44.695.000,00		70.000.000,00
10.000.000,00	101,590	10.159.000,00		10.000.000,00
100.000.000,00	71,580	71.580.000,00		100.000.000,00
30.000.000,00	93,960	28.188.000,00		30.000.000,00
10.000.000,00	94,750	9.475.000,00		10.000.000,00
10.000.000,00	91,500	9.150.000,00		10.000.000,00
10.000.000,00	78,310	7.831.000,00		10.000.000,00
10.000.000,00	97,700	9.770.000,00		10.000.000,00
15.000.000,00	84,600	12.690.000,00		15.000.000,00
10.000.000,00	82,590	8.259.000,00		10.000.000,00
25.000.000,00	103,316	25.829.000,00		25.000.000,00
20.000.000,00	103,580	20.716.000,00		20.000.000,00
15.000.000,00	96,080	14.412.000,00		15.000.000,00
20.000.000,00	84,990	16.998.000,00		20.000.000,00
20.000.000,00	63,550	12.710.000,00		20.000.000,00
5.000.000,00	91,620	4.581.000,00		5.000.000,00
5.000.000,00	90,430	4.521.500,00		5.000.000,00
3.865.780,11	78,553	3.927.660,56	1.493,84	3.865.780,11
25.000.000,00	76,100	19.025.000,00		25.000.000,00
19.900.000,00	107,640	21.528.000,00		19.900.000,00
10.000.000,00	96,790	9.679.000,00		10.000.000,00
9.925.000,00	105,028	10.502.800,00		9.925.000,00
20.000.000,00	96,590	19.318.000,00		20.000.000,00
20.000.000,00	108,100	21.620.000,00		20.000.000,00

Isin	Investimento	Valore nominale	Costo d'acquisto (in euro per i titoli USD)
XS0274190973	BNP PARIBAS EMTN 10Y DJ EUROSTOXX 50 15/11/2016	15.000.000	100,00
XS0212765704	CLASS DBLCI-MR ER NOTE 20.3.2015	50.000.000	100,00
FR0010206300	COMPAGNIE FINANCIERE DU CREDIT MUTUEL TITANIUM 2 28/12/2015	40.000.000	99,30
XS0187723969	CORSAIR FINANCE ABBACUS SIM OBBLIGAZIONI 25/10/2032	10.000.000	100,00
XS0243385688	CORSAIR FINANCE No.6 Ltd Rotating SPI Basket on a Static Port. Note 20/03/2016	30.000.000	100,00
XS0254468019	CORSAIR FINANCE SPI ROTATOR ON S&P FUNDS ON A STATIC PORTFOLIO NOTE 20/02/2029	74.000.000	191,76
XS0172778713	CREDIT LYONNAIS DFD ENHANCED INCOME BOND 2014	40.000.000	100,00
XS0525122718	CREDIT SUISSE EUR Credit Linked Notes Linked to European Inflation 26/07/2021	65.000.000	82,00
XS0308850238	CREDIT SUISSE GBP/EUR CMS 10 RANGE ACCRUAL 6/8/2022	30.000.000	96,00
XS0471035336	Credit Suisse GBP/EUR CMS 10Y Range Accrual Note 04/12/2024	35.000.000	100,00
XS0275057833	DEUTSCHE BANK 10Y PLATINUM COMMODITY DYNAMIC PARTICIPATION NOTE 21/11/2016	10.000.000	100,00
XS0221912412	DEUTSCHE BANK 10Y PRINCIPAL PROTECTED QUANTO NOTE LINKED TO BASKET OF ETFs 28/6/15	100.000.000	100,00
XS0370425364	Deutsche Bank Agriculture Tempo 25/06/2013	15.000.000	100,00
XS0370302100	Deutsche Bank First to default Credit Linked 20/06/2013	20.000.000	100,00
XS0256436311	DEUTSCHE BANK STRINT 13/06/2016	15.000.000	100,00
XS0233384832	DEUTSCHE BANK WATER BOND CAPITAL GUARANTEED WITH 1% PER YEAR AND ASIAN CALL AT EXPIRY 03/11/2012	10.000.000	100,00
XS0309481819	DRESDNER BANK PRINCIPAL PROTECTED HIGH GROWTH 06/07/2015	35.000.000	100,00
XS0355923342	EIRLES II Ltd 7Y NOTE WITH "CHINA GROWTH" PAYOFF TO AAA LEVERAGED SUPERSENIOR 28/02/2013	15.000.000	100,00
XS0275159167	EIRLES TWO 10YEUR MOMENTUM CPPI 06/12/2016 309	91.000.000	75,93
XS0238703390	ETHICAL CDO I SERIES 5 2005 - 20/03/2016	30.000.000	100,00
XS0343171608	FORTIS Capital Protected Notes linked to the Antarctica Market Neutral Fund EUR classe BX 15/02/2016	30.000.000	100,00
XS0274130136	GOLDMAN SACHS CPPI Target Redemption note on an Energy Basket 09/11/2016	35.000.000	100,00
XS0340679298	GOLDMAN SACHS Financial Products I Limited 10Y EUR Leveraged 100% Principal protected Notes 29/01/2018	10.000.000	100,00
XS0251442959	HSBC BANK Plc EUR 12Y BRIC MARKETS NOTE 26/04/2018	30.000.000	100,00
XS0350381249	INTESA SAN PAOLO S.p.A. 5Y Inflation Linked Note 04/03/2013	20.000.000	100,00
XS0368682109	INTESA SAN PAOLO S.p.A. Inflation Linked 09/06/2013	25.000.000	100,00
XS0273975499	JP MORGAN 10Y RANGE ACCRUAL SNOWBALL 15/11/2016 USD	10.000.000	77,59
XS0334928636	JP MORGAN 10Y SPI TARN GLOBAL INDICES 13/12/2017	20.000.000	100,00
XS0310440069	JP MORGAN 10Y TARGET SPI NOTE on CUSTOM YIELD ALPHA 8 BASKET 10/09/2017	20.000.000	100,00
XS0243328290	JP MORGAN 10Y TARN SPI NOTE LINKED TO A DYNAMIC BASKET 15/02/2016	20.000.000	100,00
XS0294986103	JP MORGAN 9Y TARN SPI Note on JP Morgan INCOMEFX EUR 20/06/2016	20.000.000	100,00
XS0241451581	KOMMUNALKREDIT AUSTRIA 10Y ALTERNATIVE ENERGY BOND 06/02/2016	10.000.000	100,00
XS0233362788	LLOYDS 15 YR USD SNOWBALL NOTE 03/11/2020	10.000.000	81,77
XS0226409687	MAN BLUECREST Ltd 30/09/2018	25.000.000	100,00
XS0261709744	MEDIOBANCA 7Y NOTE LINKED INFLATION TSE REIT 18/07/2013	15.000.000	100,00
XS0323461037	MEDIOBANCA GLOBAL EMERGING CURRENCY 2007-2013	10.000.000	100,00
XS0248828450	MEDIOBANCA KAIROS MULTISTRATEGY HEDGE 2006-2014	20.000.000	100,00

Valore al costo d'acquisto	Quotazione 31/12/2011 (in euro per i titoli USD)	Valore di mercato 31/12/2011	Fondo oscillazione titoli mobiliari e fondo oscillazione cambi	Valore di bilancio 31/12/2011
15.000.000,00	95,990	14.398.500,00		15.000.000,00
50.000.000,00	131,070	65.535.000,00		50.000.000,00
39.720.000,00	75,770	30.308.000,00		39.720.000,00
10.000.000,00	66,310	6.631.000,00		10.000.000,00
30.000.000,00	49,980	14.994.000,00	15.006.000,00	30.000.000,00
141.900.000,00	153,100	113.294.000,00		141.900.000,00
40.000.000,00	94,580	37.832.000,00		40.000.000,00
65.000.000,00	66,760	43.394.000,00		65.000.000,00
28.800.000,00	93,800	28.140.000,00		28.800.000,00
35.000.000,00	95,400	33.390.000,00		35.000.000,00
10.000.000,00	114,790	11.479.000,00		10.000.000,00
100.000.000,00	96,960	96.960.000,00		100.000.000,00
15.000.000,00	100,020	15.003.000,00		15.000.000,00
20.000.000,00	77,790	15.558.000,00		20.000.000,00
15.000.000,00	102,850	15.427.500,00		15.000.000,00
10.000.000,00	100,820	10.082.000,00		10.000.000,00
35.000.000,00	90,100	31.535.000,00		35.000.000,00
15.000.000,00	107,710	16.156.500,00		15.000.000,00
69.094.060,00	45,540	41.441.400,00	27.652.660,00	69.094.060,00
30.000.000,00	50,760	15.228.000,00	14.772.000,00	30.000.000,00
30.000.000,00	91,910	27.573.000,00		30.000.000,00
35.000.000,00	76,500	26.775.000,00		35.000.000,00
10.000.000,00	73,430	7.343.000,00		10.000.000,00
30.000.000,00	88,150	26.445.000,00		30.000.000,00
20.000.000,00	101,859	20.371.800,00		20.000.000,00
25.000.000,00	97,380	24.345.000,00		25.000.000,00
7.758.755,47	63,336	6.333.565,19	88.813,33	7.758.755,47
20.000.000,00	80,120	16.024.000,00		20.000.000,00
20.000.000,00	94,870	18.974.000,00		20.000.000,00
20.000.000,00	86,820	17.364.000,00		20.000.000,00
20.000.000,00	91,580	18.316.000,00		20.000.000,00
10.000.000,00	87,340	8.734.000,00		10.000.000,00
8.176.887,77	71,675	7.167.478,17	615.190,50	8.176.887,77
25.000.000,00	146,370	36.592.500,00		25.000.000,00
15.000.000,00	90,530	13.579.500,00		15.000.000,00
10.000.000,00	90,840	9.084.000,00		10.000.000,00
20.000.000,00	85,700	17.140.000,00		20.000.000,00

Isin	Investimento	Valore nominale	Costo d'acquisto (in euro per i titoli USD)
XS0340293934	MEDIOBANCA Lock the best: 10Y Equity - linked Note 25/01/2018	20.000.000	100,00
XS0346539504	MEDIOBANCA SPA OLYMPIA STAR I 13/02/2018	30.000.000	100,00
XS0208725944	MEDIOBANCA TITANIUM 10Y EMTN LINKED TO A 20 SHARE BASKET 22.12.2014	60.000.000	99,90
XS0371849422	Merrill Lynch Partecipati on Booster on Soft Commodities 25/06/2013	22.500.000	100,00
XS0233693463	MERRILL LYNCH PROTECTED PERMAL FX NOTE 24/10/2015	15.000.000	100,00
XS0352544125	ML&Co. 10Y Note linked to the DJ Euro Stoxx Select Dividend 30 Index and the DJ Euro Stoxx 50 Return Index due on 17/03/2018	20.000.000	100,00
XS0238128861	ROYAL BANK OF SCOTLAND EMTN SR 2481 2005 - 28/12/2021	30.000.000	100,00
XS0233328508	SGA ALM OPTIMIZER CLN TO SAN PAOLO IMI 21/12/2015	50.000.000	99,80
XS0312007338	SGA ALPHA MEDICAL ACCELERATOR CLN 11/09/2017	60.000.000	96,00
XS0190924539	SGA CALL ON MAX 8 COUPON 19/08/2016	20.000.000	100,00
XS0249385732	SGA ETERNAL CREDIT LINKED NOTES 30/03/2016	20.000.000	100,00
XS0276351995	SGA MEMENTHIS ALPHA CLN MORGAN STANLEY 28/11/2016	25.000.000	100,00
XS0171445967	SGA SMERALDO 10Y INFLATION LINKED 03/13	40.000.000	100,50
XS0233217859	SGA TURQUOISE ENHANCED EURO 2015 CLN TO UNICREDITO ITALIANO 23/10/2017	35.000.000	100,00
XS0261107261	SVENSK EXPORTKREDIT NOMURA 7Y TSEREIT LINKED NOTES 19/07/2013	15.000.000	100,00
XS0181479477	TER FINANCE 1.13 10/01/2013	50.000.000	107,00
XS0163367187	TER FINANCE 1.17 z.c. 18/12/2023	40.000.000	100,00
XS0181479394	TER FINANCE B.V. 1.15 24-apr-2014	50.000.000	107,00
XS0259719572	TER FINANCE Frn (JERSEY) LIMITED SERIES 2 20/07/2016 254	50.000.000	100,00
XS0279156714	TER FINANCE Frn (JERSEY) LIMITED SERIES 3 29/12/2016 312	91.000.000	76,74
XS0235773644	TER FINANCE FRN 23/11/2017	100.000.000	100,00
XS0153118608	TER FINANCE HEDGE FUND SHARES 1.11 01/11/23	30.000.000	100,00
XS0244529482	LBS AG JERSEY BRANCH-FAST NOTES 21/04/2016	30.000.000	98,50
XS0336628150	UNICREDITO 10Y GLOBAL SHIPPING SELECT INDEX 21/12/2017	10.000.000	100,00
XS0206078825	XELO II "CAMELOT" 1/11/2029 LECCE	90.500.000	79,70
XS0324333086	XELO PUBLIC LIMITED COMPANY 20/12/2017 Ferras	140.000.000	100,00
TOTALE OBBLIGAZIONI		2.714.000.000,00	
TOTALE GENERALE			

Valore al costo d'acquisto	Quotazione 31/12/2011 (in euro per i titoli USD)	Valore di mercato 31/12/2011	Fondo oscillazione titoli mobiliari e fondo oscillazione cambi	Valore di bilancio 31/12/2011
20.000.000,00	72,370	14.474.000,00		20.000.000,00
30.000.000,00	62,740	18.822.000,00		30.000.000,00
59.940.000,00	76,430	45.858.000,00		59.940.000,00
22.500.000,00	96,770	21.773.250,00		22.500.000,00
15.000.000,00	83,900	12.585.000,00		15.000.000,00
20.000.000,00	66,250	13.250.000,00		20.000.000,00
30.000.000,00	68,139	20.441.700,00		30.000.000,00
49.900.000,00	72,580	36.290.000,00		49.900.000,00
57.600.000,00	63,180	37.908.000,00		57.600.000,00
20.000.000,00	86,760	17.352.000,00		20.000.000,00
20.000.000,00	74,100	14.820.000,00		20.000.000,00
25.000.000,00	68,360	17.090.000,00		25.000.000,00
40.200.000,00	100,060	40.024.000,00		40.200.000,00
35.000.000,00	56,030	19.610.500,00	15.389.500,00	35.000.000,00
15.000.000,00	97,500	14.625.000,00		15.000.000,00
53.500.000,00	114,490	57.245.000,00		53.500.000,00
40.000.000,00	88,830	35.532.000,00		40.000.000,00
53.500.000,00	104,720	52.360.000,00		53.500.000,00
50.000.000,00	60,260	30.130.000,00	19.870.000,00	50.000.000,00
69.830.250,00	45,750	41.632.500,00	28.197.750,00	69.830.250,00
100.000.000,00	72,620	72.620.000,00		100.000.000,00
30.000.000,00	83,360	25.008.000,00		30.000.000,00
29.550.000,00	86,060	25.818.000,00		29.550.000,00
10.000.000,00	60,000	6.000.000,00	4.000.000,00	10.000.000,00
72.124.395,00	45,270	40.969.350,00	31.155.045,00	72.124.395,00
140.000.000,00	30,390	42.546.000,00	97.454.000,00	140.000.000,00
2.717.785.128,35		2.162.260.503,92	254.202.452,67	2.717.785.128,35
3.581.162.709,35		2.939.457.914,42	254.202.452,67	3.581.162.709,35