

DEBITO ESTERO PRIMA DELLE OPERAZIONI DI SWAP
(situazione al 31 marzo 2008)

Tipo tasso	Data di emissione	Data di scadenza	Importo (milioni)	Cedola
USD				
tasso fisso	06-mag-03	06-mag-08	1.250	3,25%
tasso fisso	29-mag-98	29-mag-08	2.500	6,00%
tasso fisso	03-lug-03	15-lug-08	2.000	2,50%
tasso fisso	03-mar-04	15-mag-09	2.000	3,25%
tasso fisso	05-mar-96	05-mar-10	750	5,81%
tasso fisso	14-nov-03	15-nov-10	100	4,17%
tasso fisso	09-dic-03	09-dic-10	100	4,06%
tasso fisso	22-feb-01	22-feb-11	2.000	6,00%
tasso fisso	05-mar-96	05-mar-12	1.500	6,025%
tasso fisso	01-mar-02	15-giu-12	3.000	5,625%
tasso fisso	20-dic-96	20-dic-12	1.500	5,97%
tasso fisso	27-feb-03	15-giu-13	2.000	4,375%
tasso fisso	21-gen-05	21-gen-15	4.000	4,50%
tasso fisso	27-set-93	27-set-23	3.500	6,875%
tasso fisso	27-feb-03	15-giu-33	2.000	5,375%
tasso fisso	09-mag-05	16-giu-08	3.000	4,00%
tasso fisso	25-gen-06	25-gen-16	2.000	4,75%
tasso fisso	20-set-06	20-set-16	3.000	5,25%
tasso fisso	12-giu-07	12-giu-17	2.000	5,38%
Totale USD			38.200	
Euro				
tasso variabile	11-dic-95	20-dic-10	1.023	libor 3m - 0,0625%
tasso fisso	07-mar-91	07-mar-11	2.500	9,25%
tasso variabile	22-gen-02	22-gen-12	400	3m€-0,06%
tasso fisso	29-mag-97	29-mag-12	567	6,125%
tasso fisso	25-lug-01	25-lug-16	3.000	5,750%
tasso variabile	22-mar-06	22-mar-18	1.000	6m Euribor + 0,60%
tasso variabile	08-ott-98	08-ott-18	60	libor 3m -16 b.p.
tasso variabile	15-ott-98	15-ott-18	300	3m (1+0,86*C)^0,25-1
tasso variabile	26-apr-04	26-apr-19	150	84,5% cms 10Y
tasso variabile	06-mag-99	06-mag-19	1.000	4,00%
tasso variabile	30-ago-99	30-ago-19	1.000	t.swap 30 - 0,91%
tasso variabile	08-giu-05	08-giu-20	200	85% *10yEurswap
tasso variabile	15-giu-05	15-giu-20	2.500	85% * tasso swap 10Y
tasso variabile	17-mar-06	17-mar-21	900	6m Euribor + 0,04%
tasso variabile	28-giu-05	28-giu-21	300	85,5% * tasso swap 10Y
tasso variabile	09-nov-05	09-nov-25	200	Max {0, Min [10*(CMS10 - CMS2), 6mEuribor + 1,50%]}
tasso variabile	30-mar-06	29-mar-26	300	6m Euribor + 0,075%
tasso variabile	11-mag-06	11-mag-26	215	5,07% / 10y cms
(1) tasso fisso (fino al 2009)	02-giu-05	02-giu-29	720	3,546%
tasso variabile	28-giu-99	28-giu-29	905	frn 30Y
(2) tasso fisso (fino al 2010)	02-giu-05	02-giu-30	395	3,523%
tasso fisso	20-feb-01	19-feb-31	150	0 coupon
tasso variabile	31-mag-05	31-mag-35	300	12mEur. + 0,10%
tasso fisso	28-mar-06	28-mar-36	192	capitalizzazione integrale
indicizzato	05-gen-07	15-set-57	1.032	1,85% indicizzato all'inflazione Europea
indicizzato	30-mar-07	15-set-62	258	2,00% indicizzato all'inflazione Europea
tasso fisso	05-apr-07	05-apr-27	160	4,49%
indicizzato	23-gen-08	15-set-58	507	2,20% indicizzato all'inflazione Europea
Totale Euro			20.234	
PRESTITI Ispa in Euro⁽³⁾				
tasso fisso	06-feb-04	31-lug-14	1.000	4,50%
indicizzato	06-feb-04	31-lug-19	814	2,25% cedola reale
tasso fisso	06-feb-04	31-lug-24	3.250	5,13%
tasso fisso	06-feb-04	31-lug-34	2.200	5,20%
tasso variabile	04-mar-05	31-lug-45	850	Euribor 12 M + spread 0,23% (con amm.)
tasso variabile	25-apr-05	31-lug-45	1.000	Euribor 12 M + spread 0,235% (con amm.)
tasso variabile	30-giu-05	31-lug-35	300	3,5% (con cap fino al 6,0%)
tasso variabile	30-giu-05	31-lug-35	100	3,5% (con cap fino al 6,1%)
Totale prestiti Ispa. in Euro			9.514	

(1) Successivamente il titolo paga un tasso variabile determinato con la seguente formula:
3,546% + 3 * Min [Max (3,50% - tasso swap 20Y; 0,0%); 1,50%]

(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.