

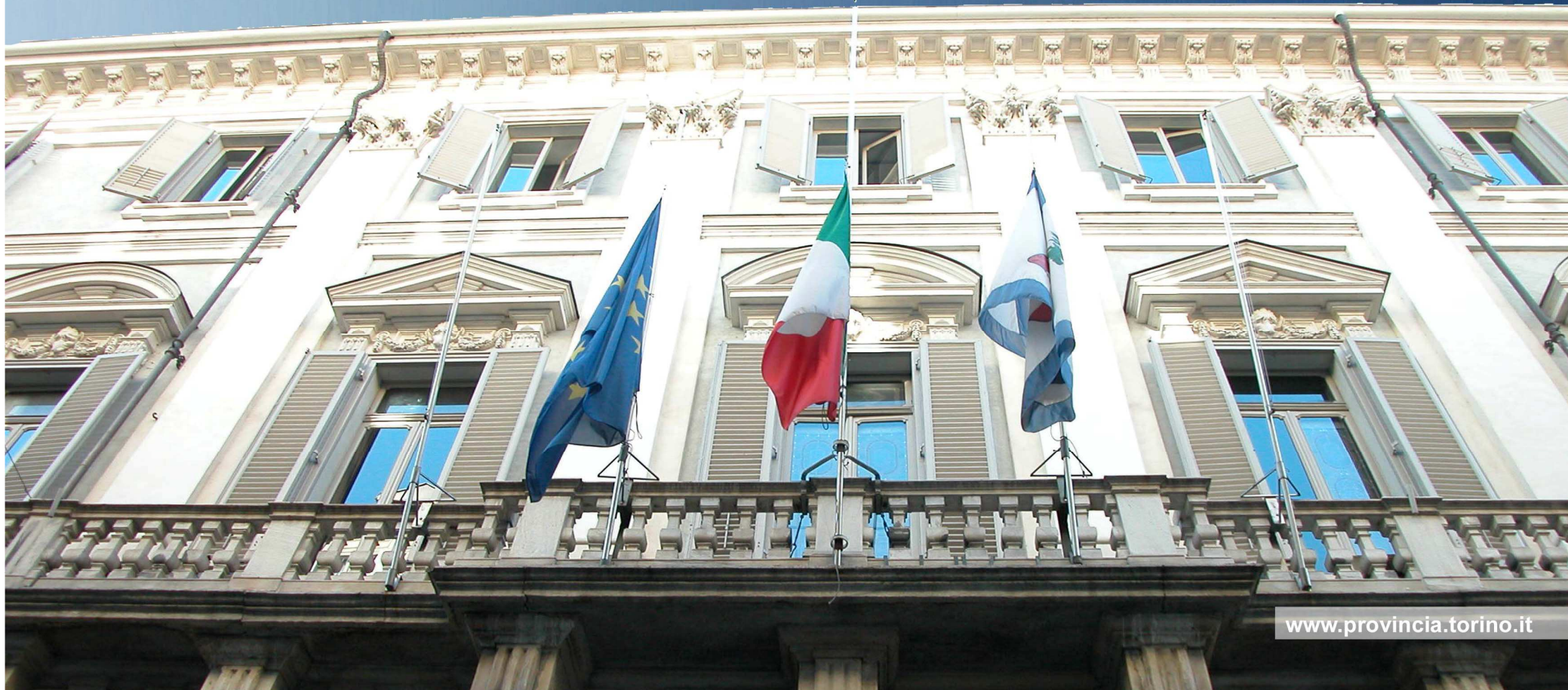


RENDICONTO DELLA GESTIONE Esercizio 2010

PROVINCIA DI TORINO

NOTA INFORMATIVA OPERAZIONI DI FINANZA DERIVATA (SWAP)

Art. 63 comma 8 D.L. n. 112/2008 convertito in Legge n. 133/2008, sostituito dell'art. 3 comma 1 della Legge n. 203/2008



“NOTA INFORMATIVA OPERAZIONI DI FINANZA DERIVATA (SWAP)”

Art. 63 comma 8 D.L. n. 112/2008 convertito nella Legge n. 133/2008,
sostituito dall’art. 3 comma 1 della Legge n. 203/2008.

L’art. 62 comma 8 del Decreto Legge 25.06.2008, modificato in sede di conversione in Legge 06.08.2008, sostituito dall’articolo 3 della legge 22.12.2008, n° 203 prevede espressamente che *“gli enti di cui al comma 2 (e pertanto gli enti locali) allegano al (omissis) bilancio consuntivo una nota informativa che evidenzi gli oneri e gli impegni finanziari (omissis) sostenuti, derivanti da contratti relativi a strumenti finanziari derivati o da contratti di finanziamento che includono una componente derivata”*.

La presente analisi è stata elaborata con il supporto informatico della società “Finance Active”.
Società alla quale (con deliberazione della Giunta Provinciale 13.03.2007, n° 228-206846/2007) è stata affidata l’analisi dell’indebitamento e la valutazione in ordine a possibili gestioni del medesimo.

CONCETTO DI SWAP

DEFINIZIONE: gli swap possono essere definiti operazioni finanziarie in cui due controparti si impegnano a scambiarsi, a date prefissate, flussi monetari (o flussi di pagamento) costituenti la risultante dell'applicazione di parametri presi a riferimento (tassi d'interesse, tassi di cambio tra valute). Il contratto di swap è pertanto uno strumento contrattuale atipico, con l'obiettivo della **GESTIONE DEL RISCHIO (COPERTURA)** e non con l'intento della speculazione.

OBIETTIVI: Con gli swap si vuole modificare l'esposizione al rischio di tasso d'interesse in funzione di politiche di copertura o di aspettative sui mercati finanziari.

RISCHI: Esiste un rischio di controparte, l'eventualità cioè che la controparte dell'operazione non sia in grado di far fronte ai propri impegni (default). Occorre pertanto effettuare una scelta di più controparti con rating alto.

VANTAGGI: Non modificano direttamente il rapporto tra i contraenti originari e quindi non richiedono il consenso o la notifica al mutuante;

- Consentono di variare l'indicizzazione anche laddove non sia possibile pervenire ad una rinegoziazione;
- Possono essere adattati alle specifiche esigenze dell'Ente se pur in ottemperanza della normativa vigente in materia di prodotti derivati;
- Possono essere contratti anche solo per un limitato numero di anni;
- Possono essere con facilità estinti anticipatamente o modificati (ristrutturazioni).

Lo Swap Strutturato per l'Ente Locale

La banca controparte nello swap "rimborsa" all'Ente l'importo d'interessi che l'Ente paga sul mutuo (ad es. fissi).

In contropartita, l'Ente paga alla banca flussi di interesse sulla base della nuova forma di indicizzazione prescelta (variabile, variabile con collar, etc.).

MARK TO MARKET

Il Mark to Market è un procedimento di rivalutazione giornaliera di un portafoglio di beni di investimento sulla base dei prezzi espressi dal mercato, che differisce da quello in cui il valore del portafoglio è calcolato sulla base dei costi storici di acquisizione dei beni.

Fino al momento in cui i beni non saranno fisicamente rimossi dal portafoglio, ogni giorno verrà calcolato un profitto o una perdita puramente contabile, appurata solo al momento della chiusura della posizione.

Un esempio è dato dai conti in titoli, che operano con il sistema del margine, dove tutti i giorni, sulla base delle quotazioni di mercato, l'intermediario valuta il profitto o la perdita di una posizione e se necessario a richiedere all'investitore nuovi fondi a garanzia della posizione.

Essendo swap di interesse sono del tutto reversibili, sono chiudibili in qualsiasi momento il prezzo di chiusura è rappresentato dal Mark to Market.

Fondo accantonamento rischi operazioni di swap

Al fine di contenere gli effetti dei rischi conseguenti alle operazioni in questione, è stato costituito uno specifico “fondo accantonamento rischi operazioni di swap”. Il fondo in questione è stato integrato anno per anno a decorrere dal 2002 addivenendo ad uno stanziamento attuale, affluito nell'avanzo di amministrazione 2010 – fondi vincolati – pari ad Euro 1.778.636,00.

Sintesi di presentazione

Il documento è suddiviso in tre parti:

- 1).** Situazione sintetica della finanza derivata provinciale al 31 dicembre 2010.

- 2).** Situazione analitica di ogni singola operazione di swap (SCHEDA) contenente:
 - Il valore nozionale,
 - Le scadenze,
 - Il debito residuo al 31.12.2010,
 - L'ammortamento, la durata e le caratteristiche salienti di ogni singola operazione.
 - Lo scadenziario attuale e storico dei pagamenti/incassi; nonché le previsioni di pagamento future prese al 31 dicembre 2010.

- 3).** L'evoluzione della scheda sintetica dei valori del "mark to market" rilevati alla fine di ogni mese del 2010.

Debito swap Provincia di Torino – ANNO 2009

Data di valorizzazione e visualizzazione: 31 dicembre 2010

Documento realizzato per Provincia di Torino da parte di Finance Active

(N.B. il valore * nella tabella dello scadenziario corrisponde alle proiezioni forward per i vari periodi dell'Euribor, estratto al 31 dicembre 2010)

I prodotti derivati

Tipo di prodotti derivati	Nominale	Tasso medio	Tasso medio ricevuto
Nozionale globale	256 972 543.41 €	2.72 %	2.13 %
Swap pagatore Tasso Fisso	-	-	-
Swap pagatore Tasso Fisso Debole	256 972 543.41 €	2.72 %	2.13 %
Swap pagatore Tasso Variabile Debole	-	-	-
Swap pagatore Tasso Variabile	-	-	-

I Vostri prodotti derivati

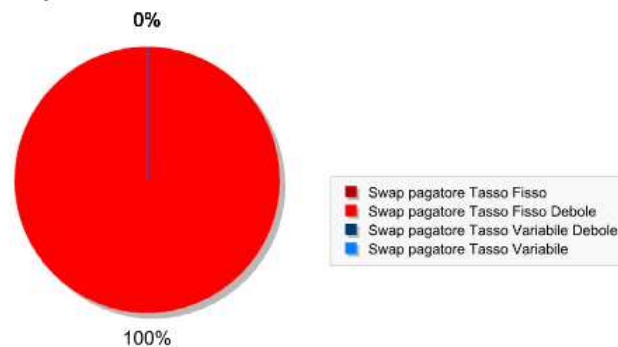











Tabella dei contratti swap a fine 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Tasso ricevuto	Tasso pagato
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 183 200.00 €	8.82 anni	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		6 736 663.79 €	7.97 anni	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		50 718 524.50 €	14.50 anni	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		83 884 052.56 €	24.49 anni	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		83 884 052.56 €	24.49 anni	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.73 anni	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.73 anni	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 170 200.00 €	11.96 anni	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 170 200.00 €	11.96 anni	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
			256 972 543.41 €			

SCHEDE ANALITICHE DEI VARI CONTRATTI DI SWAP

Swap-01-Dexia-Crediop

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	7 901 600.00 €	Data di incasso :	26/10/2002	Data di fine :	26/10/2019
Valuta di origine :	€	debito residuo	4 183 200.00 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	Swap 01	Istituto :	Dexia Crediop
------------	---	---------------	---------	------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	4 183 200.00 €	Periodicità d'ammortamento	annuale
Tasso di progressività	-	Durata residua (anno)	8.82 anni	Valorizzazione	* 478 877.14 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	Periodo	annuale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	esatto	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
26/10/2002	26/10/2005		Euribor 12 M+(-0.31)
26/10/2005	26/10/2019		Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M

Dexia Crediop pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 12 M	Periodo	annuale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo

Riferimento	InAdvance	Arrotondato	esatto	Valuta	€
--------------------	-----------	--------------------	--------	---------------	---

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
26/10/2002	26/10/2019		Euribor 12 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	26/10/2011	Data d'inizio	26/10/2010	Data di fine	26/10/2011
Data di fixing	22/10/2010	Valore del tasso	4.9400 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	365	Nozionale	4 183 200.00 €	Interessi periodo	209 520.22 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	26/10/2011	Data d'inizio	26/10/2010	Data di fine	26/10/2011
Data di fixing	22/10/2010	Valore di tasso	1.5190 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	365	Nozionale	4 183 200.00 €	Interessi periodo	64 425.35 €

Netting

Data	26/10/2011	Senso	Pagate	Ammontare	145 094.87 €
-------------	------------	--------------	--------	------------------	--------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	4.9400 %
Euribor 12 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.5170 %
Euribor 12 M+(-0.31)	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	-0.3100 %	1.2070 %

Scadenzario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
7 901 600.00 €	250 274.40 €	3.1240 %		225 439.23 €	2.8140 %		-24 835.17 €	26/10/2003
7 436 800.00 €	174 275.21 €	2.3050 %		150 836.90 €	1.9950 %		-23 438.31 €	26/10/2004
6 972 000.00 €	161 522.84 €	2.2850 %		139 609.46 €	1.9750 %		-21 913.38 €	26/10/2005
6 507 200.00 €	159 727.36 €	2.4210 %		325 920.34 €	4.9400 %		166 192.98 €	26/10/2006
6 042 400.00 €	234 944.46 €	3.8350 %		302 640.32 €	4.9400 %		67 695.86 €	26/10/2007
5 577 600.00 €	259 371.41 €	4.5740 %		280 125.66 €	4.9400 %		20 754.25 €	26/10/2008
5 112 800.00 €	262 300.84 €	5.0600 %		256 080.27 €	4.9400 %		-6 220.57 €	26/10/2009
4 648 000.00 €	59 048.32 €	1.2530 %		232 800.24 €	4.9400 %		173 751.92 €	26/10/2010
4 183 200.00 €	64 425.35 €	1.5190 %		209 520.22 €	4.9400 %		145 094.87 €	26/10/2011
3 718 400.00 €	* 67 248.15 €	* 1.7789 %		* 186 750.44 €	* 4.9400 %		* 119 502.29 €	26/10/2012
3 253 600.00 €	* 82 049.10 €	* 2.4872 %		* 162 960.17 €	* 4.9400 %		* 80 911.07 €	26/10/2013
2 788 800.00 €	* 97 848.97 €	* 3.4606 %		* 139 680.15 €	* 4.9400 %		* 41 831.18 €	26/10/2014
2 324 000.00 €	* 86 064.30 €	* 3.6526 %		* 116 400.12 €	* 4.9400 %		* 30 335.82 €	26/10/2015
1 859 200.00 €	* 74 343.87 €	* 3.9331 %		* 93 375.22 €	* 4.9400 %		* 19 031.35 €	26/10/2016
1 394 400.00 €	* 58 650.18 €	* 4.1485 %		* 69 840.07 €	* 4.9400 %		* 11 189.89 €	26/10/2017
929 600.00 €	* 40 739.70 €	* 4.3225 %		* 46 560.05 €	* 4.9400 %		* 5 820.35 €	26/10/2018
464 800.00 €	* 20 694.33 €	* 4.3913 %		* 23 280.02 €	* 4.9400 %		* 2 585.69 €	26/10/2019
	* 2 153 528.79 €			* 2 961 818.88 €			* 808 290.09 €	

Swap-02-Dexia-Crediop

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	13 473 327.58 €	Data di incasso :	19/12/2002	Data di fine :	19/12/2018
Valuta di origine :	€	debito residuo	6 736 663.79 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	swap-02	Istituto :	Dexia Crediop
-------------------	---	----------------------	---------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	6 736 663.79 €	Periodicità d'ammortamento	annuale
Tasso di progressività	4.9800 %	Durata residua (anno)	7.97 anni	Valorizzazione	* 723 334.04 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	Periodo	annuale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-4 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
19/12/2002	19/12/2005		Euribor 12 M+(-0.31)
19/12/2005	19/12/2018		Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M

Dexia Crediop pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 12 M	Periodo	annuale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-4 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
19/12/2002	19/12/2018		Euribor 12 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	19/12/2011	Data d'inizio	19/12/2010	Data di fine	19/12/2011
Data di fixing	14/12/2010	Valore del tasso	4.9800 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	365	Nozionale	6 736 663.79 €	Interessi periodo	340 145.38 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	19/12/2011	Data d'inizio	19/12/2010	Data di fine	19/12/2011
Data di fixing	14/12/2010	Valore di tasso	1.5300 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	365	Nozionale	6 736 663.79 €	Interessi periodo	104 502.50 €

Netting

Data	19/12/2011	Senso	Pagate	Ammontare	235 642.88 €
-------------	------------	--------------	--------	------------------	--------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	In advance	G-4 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	4.9800 %
Euribor 12 M	In advance	G-4 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.5200 %
Euribor 12 M+(-0.31)	In advance	G-4 Giorno lavorativo	exact/360	-0.3100 %	1.2100 %

Scadenzario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
13 473 327.58 €	389 186.42 €	2.8490 %		346 839.01 €	2.5390 %		-42 347.41 €	19/12/2003
12 631 244.60 €	304 478.26 €	2.3710 %		264 668.78 €	2.0610 %		-39 809.48 €	19/12/2004
11 789 161.63 €	270 494.13 €	2.2630 %		233 440.14 €	1.9530 %		-37 053.99 €	19/12/2005
10 947 078.66 €	307 334.67 €	2.7690 %		552 736.25 €	4.9800 %		245 401.58 €	19/12/2006
10 104 995.69 €	399 670.82 €	3.9010 %		510 218.07 €	4.9800 %		110 547.25 €	19/12/2007
9 262 912.71 €	457 868.86 €	4.8620 %		468 981.27 €	4.9800 %		11 112.41 €	19/12/2008
8 420 829.74 €	292 931.43 €	3.4310 %		425 181.73 €	4.9800 %		132 250.30 €	19/12/2009
7 578 746.77 €	95 896.41 €	1.2480 %		382 663.56 €	4.9800 %		286 767.15 €	19/12/2010
6 736 663.79 €	104 502.50 €	1.5300 %		340 145.38 €	4.9800 %		235 642.88 €	19/12/2011
5 894 580.82 €	* 110 042.05 €	* 1.8362 %		* 298 442.63 €	* 4.9800 %		* 188 400.58 €	19/12/2012
5 052 497.84 €	* 134 978.41 €	* 2.6349 %		* 255 109.04 €	* 4.9800 %		* 120 130.63 €	19/12/2013
4 210 414.87 €	* 146 936.39 €	* 3.4420 %		* 212 590.86 €	* 4.9800 %		* 65 654.47 €	19/12/2014
3 368 331.90 €	* 126 780.22 €	* 3.7123 %		* 170 072.69 €	* 4.9800 %		* 43 292.47 €	19/12/2015
2 526 248.92 €	* 101 747.72 €	* 3.9616 %		* 127 903.98 €	* 4.9800 %		* 26 156.26 €	19/12/2016
1 684 165.95 €	* 71 339.04 €	* 4.1778 %		* 85 036.35 €	* 4.9800 %		* 13 697.31 €	19/12/2017
842 082.97 €	* 37 032.48 €	* 4.3375 %		* 42 518.17 €	* 4.9800 %		* 5 485.69 €	19/12/2018
	* 3 351 219.81 €			* 4 716 547.91 €			* 1 365 328.10 €	

Swap-03-Dexia-Crediop

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	55 257 889.47 €	Data di incasso :	30/06/2005	Data di fine :	30/06/2025
Valuta di origine :	€	debito residuo	50 718 524.50 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	swap-03	Istituto :	Dexia Crediop
-------------------	---	----------------------	---------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	50 718 524.50 €	Periodicità d'ammortamento	Semestrale
Tasso di progressività	5.5500 %	Durata residua (anno)	14.50 anni	Valorizzazione	* 950 890.10 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	Periodo	Semestrale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.7500 %	Fixing	G-10 Giorno lavorativo
Riferimento	In arrears	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
30/06/2005	31/12/2005		3.3 %
31/12/2005	31/12/2006		4.99 %
31/12/2006	30/06/2011		(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75
30/06/2011	30/06/2025		(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.55/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75

Dexia Crediop pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	5.55 %	Periodo	Semestrale
Base	30/360	Margine	0.0000 %	Fixing	
Riferimento	-	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
30/06/2005	30/06/2025		5.55 %

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	30/06/2011	Data d'inizio	31/12/2010	Data di fine	30/06/2011
Data di fixing	16/06/2011	Valore del tasso	* 5.1000 %	Tipo	valutato
Numero di giorni	181	Nozionale	50 718 524.50 €	Interessi periodo	* 1 300 507.50 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	30/06/2011	Data d'inizio	31/12/2010	Data di fine	30/06/2011
Data di fixing		Valore di tasso	5.5500 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	181	Nozionale	50 718 524.50 €	Interessi periodo	1 407 439.05 €

Netting















Data	30/06/2011	Senso	Ricevete	Ammontare	* 106 931.55 €
-------------	------------	--------------	----------	------------------	----------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	In arrears	G-10 Giorno lavorativo	exact/360	0.7500 %	5.1000 %
(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.55/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	In arrears	G-10 Giorno lavorativo	exact/360	0.7500 %	5.3000 %
3.3 %			exact/360	0.0000 %	3.3000 %
4.99 %			exact/360	0.0000 %	4.9900 %
5.55 %			30/360	0.0000 %	5.5500 %

Scadenario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
55 257 889.47 €	1 533 406.43 €	5.5500 %	●	932 016.40 €	3.3000 %	●	-601 390.03 €	31/12/2005
55 057 889.47 €	1 527 856.43 €	5.5500 %	●	1 381 325.98 €	4.9900 %	●	-146 530.45 €	30/06/2006
54 707 889.47 €	1 518 143.93 €	5.5500 %	●	1 395 294.33 €	4.9900 %	●	-122 849.60 €	31/12/2006
54 444 847.41 €	1 510 844.52 €	5.5500 %	●	1 396 056.63 €	5.1000 %	●	-114 787.89 €	30/06/2007
54 021 653.25 €	1 499 100.88 €	5.5500 %	●	1 559 473.08 €	5.6480 %	●	60 372.20 €	31/12/2007
53 586 938.77 €	1 487 037.55 €	5.5500 %	●	1 591 877.42 €	5.8760 %	●	104 839.87 €	30/06/2008
53 140 389.90 €	1 474 645.82 €	5.5500 %	●	1 385 192.83 €	5.1000 %	●	-89 452.99 €	31/12/2008
52 681 684.01 €	1 461 916.73 €	5.5500 %	●	1 350 846.18 €	5.1000 %	●	-111 070.55 €	30/06/2009
52 210 489.68 €	1 448 841.09 €	5.5500 %	●	1 360 953.43 €	5.1000 %	●	-87 887.66 €	31/12/2009
51 726 466.43 €	1 435 409.44 €	5.5500 %	●	1 326 352.81 €	5.1000 %	●	-109 056.63 €	30/06/2010
51 229 264.47 €	1 421 612.09 €	5.5500 %	●	1 335 376.16 €	5.1000 %	●	-86 235.93 €	31/12/2010
50 718 524.50 €	1 407 439.05 €	5.5500 %	●	* 1 300 507.50 €	* 5.1000 %	●	* -106 931.55 €	30/06/2011
50 193 877.38 €	1 392 880.10 €	5.5500 %	●	* 1 359 696.37 €	* 5.3000 %	●	* -33 183.73 €	31/12/2011
49 654 943.90 €	1 377 924.69 €	5.5500 %	●	* 1 330 476.64 €	* 5.3000 %	●	* -47 448.05 €	30/06/2012
49 101 334.52 €	1 362 562.03 €	5.5500 %	●	* 1 330 100.60 €	* 5.3000 %	●	* -32 461.43 €	31/12/2012
48 532 649.05 €	1 346 781.01 €	5.5500 %	●	* 1 293 260.28 €	* 5.3000 %	●	* -53 520.73 €	30/06/2013
47 948 476.36 €	1 330 570.22 €	5.5500 %	●	* 1 298 870.95 €	* 5.3000 %	●	* -31 699.27 €	31/12/2013
47 348 394.13 €	1 313 917.94 €	5.5500 %	●	* 1 261 703.18 €	* 5.3000 %	●	* -52 214.76 €	30/06/2014
46 731 968.49 €	1 296 812.13 €	5.5500 %	●	* 1 265 917.10 €	* 5.3000 %	●	* -30 895.03 €	31/12/2014
46 098 753.73 €	1 279 240.42 €	5.5500 %	●	* 1 228 403.73 €	* 5.3000 %	●	* -50 836.69 €	30/06/2015
45 448 291.96 €	1 261 190.10 €	5.5500 %	●	* 1 231 143.73 €	* 5.3000 %	●	* -30 046.37 €	31/12/2015
44 780 112.80 €	1 242 648.13 €	5.5500 %	●	* 1 199 858.24 €	* 5.3000 %	●	* -42 789.89 €	30/06/2016
44 093 733.04 €	1 223 601.09 €	5.5500 %	●	* 1 194 450.24 €	* 5.3000 %	●	* -29 150.85 €	31/12/2016
43 388 656.26 €	1 204 035.21 €	5.5500 %	●	* 1 156 187.17 €	* 5.3000 %	●	* -47 848.04 €	30/06/2017
42 664 372.49 €	1 183 936.34 €	5.5500 %	●	* 1 155 730.45 €	* 5.3000 %	●	* -28 205.89 €	31/12/2017
41 920 357.83 €	1 163 289.93 €	5.5500 %	●	* 1 117 061.09 €	* 5.3000 %	●	* -46 228.84 €	30/06/2018
41 156 074.08 €	1 142 081.06 €	5.5500 %	●	* 1 114 872.32 €	* 5.3000 %	●	* -27 208.74 €	31/12/2018
40 370 968.34 €	1 120 294.37 €	5.5500 %	●	* 1 075 774.16 €	* 5.3000 %	●	* -44 520.21 €	30/06/2019
39 564 472.64 €	1 097 914.12 €	5.5500 %	●	* 1 071 757.60 €	* 5.3000 %	●	* -26 156.52 €	31/12/2019
38 736 003.45 €	1 074 924.10 €	5.5500 %	●	* 1 037 909.69 €	* 5.3000 %	●	* -37 014.41 €	30/06/2020
37 884 961.35 €	1 051 307.68 €	5.5500 %	●	* 1 026 261.51 €	* 5.3000 %	●	* -25 046.17 €	31/12/2020
37 010 730.53 €	1 027 047.77 €	5.5500 %	●	* 986 233.16 €	* 5.3000 %	●	* -40 814.61 €	30/06/2021
36 112 678.37 €	1 002 126.82 €	5.5500 %	●	* 979 935.22 €	* 5.3091 %	●	* -22 191.60 €	31/12/2021

35 190 154.96 €	976 526.80 €	5.5500 %		* 940 810.75 €	* 5.3175 %		* -35 716.05 €	30/06/2022
34 242 492.67 €	950 229.17 €	5.5500 %		* 928 729.99 €	* 5.3065 %		* -21 499.18 €	31/12/2022
33 269 005.60 €	923 214.91 €	5.5500 %		* 886 526.59 €	* 5.3000 %		* -36 688.32 €	30/06/2023
32 268 989.15 €	895 464.45 €	5.5500 %		* 874 131.06 €	* 5.3000 %		* -21 333.39 €	31/12/2023
31 241 719.45 €	866 957.71 €	5.5500 %		* 837 104.52 €	* 5.3000 %		* -29 853.19 €	30/06/2024
30 186 452.89 €	837 674.07 €	5.5500 %		* 817 717.47 €	* 5.3000 %		* -19 956.60 €	31/12/2024
29 102 425.51 €	807 592.31 €	5.5500 %		* 775 498.80 €	* 5.3000 %		* -32 093.51 €	30/06/2025
	49 478 998.64 €			* 47 091 395.36 €			* -2 387 603.28 €	

Swap-04-Dexia-Crediop

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	86 085 833.68 €	Data di incasso :	31/12/2005	Data di fine :	27/06/2035
Valuta di origine :	€	debito residuo	83 884 052.56 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	swap-04	Istituto :	Dexia Crediop
-------------------	---	----------------------	---------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	83 884 052.56 €	Periodicità d'ammortamento	Semestrale
Tasso di progressività	-	Durata residua (anno)	24.49 anni	Valorizzazione	* 13 651 814.07 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	27/12/2012		Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
27/12/2012	27/06/2035		5.4125 %

Dexia Crediop pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	27/06/2035		Euribor 06 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	27/06/2011	Data d'inizio	27/12/2010	Data di fine	27/06/2011
Data di fixing	23/12/2010	Valore del tasso	1.9000 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	83 884 052.56 €	Interessi periodo	805 752.93 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	27/06/2011	Data d'inizio	27/12/2010	Data di fine	27/06/2011
Data di fixing	23/12/2010	Valore di tasso	1.2480 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	83 884 052.56 €	Interessi periodo	529 252.45 €

Netting





















































Data	27/06/2011	Senso	Pagate	Ammontare	276 500.48 €
-------------	------------	--------------	--------	------------------	--------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
5.4125 %			exact/360	0.0000 %	5.4125 %
Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.2380 %
Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.9000 %

Scadenzario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
86 085 833.68 €	1 122 430.14 €	2.6370 %	●	1 122 430.14 €	2.6370 %	●	0.00 €	27/06/2006
85 985 438.00 €	1 390 828.79 €	3.1820 %	●	1 390 828.79 €	3.1820 %	●	0.00 €	27/12/2006
85 885 042.32 €	1 661 236.20 €	3.8260 %	●	1 661 236.20 €	3.8260 %	●	0.00 €	27/06/2007
85 634 918.60 €	1 869 224.73 €	4.2940 %	●	1 869 224.73 €	4.2940 %	●	0.00 €	27/12/2007
85 384 794.88 €	2 075 142.25 €	4.7810 %	●	2 075 142.25 €	4.7810 %	●	0.00 €	27/06/2008
85 134 671.16 €	2 242 175.28 €	5.1250 %	●	2 242 175.28 €	5.1250 %	●	0.00 €	29/12/2008
84 884 547.44 €	1 326 896.38 €	3.0920 %	●	1 326 896.38 €	3.0920 %	●	0.00 €	29/06/2009
84 634 423.72 €	579 341.44 €	1.3540 %	●	812 960.66 €	1.9000 %	●	233 619.22 €	28/12/2009
84 384 300.00 €	423 196.64 €	0.9920 %	●	810 558.08 €	1.9000 %	●	387 361.44 €	28/06/2010
84 134 176.28 €	436 829.32 €	1.0270 %	●	808 155.50 €	1.9000 %	●	371 326.18 €	27/12/2010
83 884 052.56 €	529 252.45 €	1.2480 %	●	805 752.93 €	1.9000 %	●	276 500.48 €	27/06/2011
83 633 928.84 €	* 559 999.89 €	* 1.3172 %	●	* 807 764.36 €	* 1.9000 %	●	* 247 764.47 €	27/12/2011
83 383 805.12 €	* 657 734.48 €	* 1.5517 %	●	* 805 348.58 €	* 1.9000 %	●	* 147 614.10 €	27/06/2012
82 552 944.32 €	* 787 136.65 €	* 1.8757 %	●	* 797 323.85 €	* 1.9000 %	●	* 10 187.20 €	27/12/2012
81 697 850.08 €	* 967 302.42 €	* 2.3420 %	●	2 235 514.16 €	5.4125 %	●	* 1 268 211.74 €	27/06/2013
80 816 791.44 €	* 1 159 647.39 €	* 2.8228 %	●	2 223 556.16 €	5.4125 %	●	* 1 063 908.77 €	27/12/2013
79 908 902.92 €	* 1 217 902.21 €	* 3.0147 %	●	2 186 562.85 €	5.4125 %	●	* 968 660.64 €	27/06/2014
78 974 184.52 €	* 1 337 793.12 €	* 3.2964 %	●	2 196 606.61 €	5.4125 %	●	* 858 813.49 €	29/12/2014
78 011 770.76 €	* 1 394 120.44 €	* 3.5349 %	●	2 134 651.25 €	5.4125 %	●	* 740 530.81 €	29/06/2015
77 019 930.68 €	* 1 437 293.11 €	* 3.6912 %	●	2 107 511.34 €	5.4125 %	●	* 670 218.23 €	28/12/2015
75 998 664.28 €	* 1 458 363.49 €	* 3.7957 %	●	2 079 566.23 €	5.4125 %	●	* 621 202.74 €	27/06/2016
74 946 240.60 €	* 1 483 156.88 €	* 3.8930 %	●	2 062 036.51 €	5.4125 %	●	* 578 879.63 €	27/12/2016
73 862 659.64 €	* 1 496 478.43 €	* 4.0075 %	●	2 021 118.32 €	5.4125 %	●	* 524 639.89 €	27/06/2017
72 746 190.44 €	* 1 521 612.74 €	* 4.1148 %	●	2 001 505.34 €	5.4125 %	●	* 479 892.60 €	27/12/2017
71 596 833.00 €	* 1 519 405.25 €	* 4.1977 %	●	1 959 118.06 €	5.4125 %	●	* 439 712.81 €	27/06/2018
70 412 856.36 €	* 1 519 128.40 €	* 4.2442 %	●	1 937 307.06 €	5.4125 %	●	* 418 178.66 €	27/12/2018
69 193 395.04 €	* 1 493 459.70 €	* 4.2693 %	●	1 893 352.32 €	5.4125 %	●	* 399 892.62 €	27/06/2019
67 936 718.08 €	* 1 485 423.63 €	* 4.3013 %	●	1 869 179.72 €	5.4125 %	●	* 383 756.09 €	27/12/2019
66 642 825.48 €	* 1 491 527.14 €	* 4.3552 %	●	1 853 619.28 €	5.4125 %	●	* 362 092.14 €	29/06/2020
65 309 986.28 €	* 1 459 746.88 €	* 4.4211 %	●	1 787 089.85 €	5.4125 %	●	* 327 342.97 €	28/12/2020
63 937 335.00 €	* 1 449 000.28 €	* 4.4828 %	●	1 749 529.73 €	5.4125 %	●	* 300 529.45 €	28/06/2021
62 523 140.68 €	* 1 432 012.13 €	* 4.5304 %	●	1 710 832.86 €	5.4125 %	●	* 278 820.73 €	27/12/2021
61 066 537.84 €	* 1 407 711.68 €	* 4.5598 %	●	1 670 975.55 €	5.4125 %	●	* 263 263.87 €	27/06/2022

59 566 661.00 €	* 1 382 988.76 €	* 4.5674 %		1 638 889.81 €	5.4125 %		* 255 901.05 €	27/12/2022
58 021 779.20 €	* 1 336 380.47 €	* 4.5559 %		1 587 661.23 €	5.4125 %		* 251 280.76 €	27/06/2023
56 430 161.48 €	* 1 298 995.11 €	* 4.5284 %		1 552 593.60 €	5.4125 %		* 253 598.49 €	27/12/2023
54 790 942.36 €	* 1 251 035.06 €	* 4.4917 %		1 507 492.88 €	5.4125 %		* 256 457.82 €	27/06/2024
53 102 390.88 €	* 1 200 071.88 €	* 4.4457 %		1 461 034.84 €	5.4125 %		* 260 962.96 €	27/12/2024
51 363 641.56 €	* 1 141 152.89 €	* 4.3946 %		1 405 473.31 €	5.4125 %		* 264 320.42 €	27/06/2025
49 572 097.96 €	* 1 104 239.70 €	* 4.3347 %		1 378 810.04 €	5.4125 %		* 274 570.34 €	29/12/2025
47 726 894.60 €	* 1 030 038.24 €	* 4.2690 %		1 305 960.30 €	5.4125 %		* 275 922.06 €	29/06/2026
45 826 300.52 €	* 971 913.82 €	* 4.1951 %		1 253 953.97 €	5.4125 %		* 282 040.15 €	28/12/2026
43 869 450.24 €	* 913 042.39 €	* 4.1168 %		1 200 408.30 €	5.4125 %		* 287 365.91 €	28/06/2027
41 853 747.32 €	* 853 183.49 €	* 4.0322 %		1 145 252.23 €	5.4125 %		* 292 068.74 €	27/12/2027
39 777 460.80 €	* 797 504.35 €	* 3.9441 %		1 094 418.83 €	5.4125 %		* 296 914.48 €	27/06/2028
37 638 859.72 €	* 737 081.48 €	* 3.8524 %		1 035 578.34 €	5.4125 %		* 298 496.86 €	27/12/2028
35 436 213.12 €	* 673 530.52 €	* 3.7596 %		969 647.99 €	5.4125 %		* 296 117.47 €	27/06/2029
33 166 924.56 €	* 617 496.93 €	* 3.6625 %		912 539.56 €	5.4125 %		* 295 042.63 €	27/12/2029
30 830 128.56 €	* 556 237.76 €	* 3.5688 %		843 610.80 €	5.4125 %		* 287 373.04 €	27/06/2030
28 423 228.68 €	* 501 574.44 €	* 3.4715 %		782 023.69 €	5.4125 %		* 280 449.25 €	27/12/2030
25 943 628.48 €	* 443 044.48 €	* 3.3779 %		709 900.55 €	5.4125 %		* 266 856.07 €	27/06/2031
23 389 597.00 €	* 394 740.30 €	* 3.2841 %		650 563.77 €	5.4125 %		* 255 823.47 €	29/12/2031
20 759 403.28 €	* 335 177.44 €	* 3.1937 %		568 043.59 €	5.4125 %		* 232 866.15 €	28/06/2032
18 050 450.88 €	* 283 269.92 €	* 3.1042 %		493 918.00 €	5.4125 %		* 210 648.08 €	27/12/2032
15 260 143.36 €	* 232 899.75 €	* 3.0188 %		417 566.27 €	5.4125 %		* 184 666.52 €	27/06/2033
12 385 884.28 €	* 184 973.18 €	* 2.9379 %		340 779.54 €	5.4125 %		* 155 806.36 €	27/12/2033
9 425 077.20 €	* 136 387.03 €	* 2.8623 %		257 900.22 €	5.4125 %		* 121 513.19 €	27/06/2034
6 375 991.16 €	* 90 514.40 €	* 2.7927 %		175 426.10 €	5.4125 %		* 84 911.70 €	27/12/2034
3 235 164.24 €	* 44 656.93 €	* 2.7304 %		88 524.43 €	5.4125 %		* 43 867.50 €	27/06/2035
	* 60 904 640.68 €			* 79 793 403.12 €			* 18 888 762.44 €	

Swap-04-Merrill-Lynch

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	86 085 833.68 €	Data di incasso :	31/12/2005	Data di fine :	27/06/2035
Valuta di origine :	€	debito residuo	83 884 052.56 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	swap-04	Istituto :	Merrill Lynch
-------------------	---	----------------------	---------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	83 884 052.56 €	Periodicità d'ammortamento	Semestrale
Tasso di progressività	-	Durata residua (anno)	24.49 anni	Valorizzazione	* 13 651 814.07 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	27/12/2012		Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
27/12/2012	27/06/2035		5.4125 %

Merrill Lynch pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	27/06/2035		Euribor 06 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	27/06/2011	Data d'inizio	27/12/2010	Data di fine	27/06/2011
Data di fixing	23/12/2010	Valore del tasso	1.9000 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	83 884 052.56 €	Interessi periodo	805 752.93 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	27/06/2011	Data d'inizio	27/12/2010	Data di fine	27/06/2011
Data di fixing	23/12/2010	Valore di tasso	1.2480 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	83 884 052.56 €	Interessi periodo	529 252.45 €

Netting





















































Data	27/06/2011	Senso	Pagate	Ammontare	276 500.48 €
-------------	------------	--------------	--------	------------------	--------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
5.4125 %			exact/360	0.0000 %	5.4125 %
Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.2380 %
Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.9000 %

Scadenario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
86 085 833.68 €	1 122 430.14 €	2.6370 %	●	1 122 430.14 €	2.6370 %	●	0.00 €	27/06/2006
85 985 438.00 €	1 390 828.79 €	3.1820 %	●	1 390 828.79 €	3.1820 %	●	0.00 €	27/12/2006
85 885 042.32 €	1 661 236.20 €	3.8260 %	●	1 661 236.20 €	3.8260 %	●	0.00 €	27/06/2007
85 634 918.60 €	1 869 224.73 €	4.2940 %	●	1 869 224.73 €	4.2940 %	●	0.00 €	27/12/2007
85 384 794.88 €	2 075 142.25 €	4.7810 %	●	2 075 142.25 €	4.7810 %	●	0.00 €	27/06/2008
85 134 671.16 €	2 242 175.28 €	5.1250 %	●	2 242 175.28 €	5.1250 %	●	0.00 €	29/12/2008
84 884 547.44 €	1 326 896.38 €	3.0920 %	●	1 326 896.38 €	3.0920 %	●	0.00 €	29/06/2009
84 634 423.72 €	579 341.44 €	1.3540 %	●	812 960.66 €	1.9000 %	●	233 619.22 €	28/12/2009
84 384 300.00 €	423 196.64 €	0.9920 %	●	810 558.08 €	1.9000 %	●	387 361.44 €	28/06/2010
84 134 176.28 €	436 829.32 €	1.0270 %	●	808 155.50 €	1.9000 %	●	371 326.18 €	27/12/2010
83 884 052.56 €	529 252.45 €	1.2480 %	●	805 752.93 €	1.9000 %	●	276 500.48 €	27/06/2011
83 633 928.84 €	* 559 999.89 €	* 1.3172 %	●	* 807 764.36 €	* 1.9000 %	●	* 247 764.47 €	27/12/2011
83 383 805.12 €	* 657 734.48 €	* 1.5517 %	●	* 805 348.58 €	* 1.9000 %	●	* 147 614.10 €	27/06/2012
82 552 944.32 €	* 787 136.65 €	* 1.8757 %	●	* 797 323.85 €	* 1.9000 %	●	* 10 187.20 €	27/12/2012
81 697 850.08 €	* 967 302.42 €	* 2.3420 %	●	2 235 514.16 €	5.4125 %	●	* 1 268 211.74 €	27/06/2013
80 816 791.44 €	* 1 159 647.39 €	* 2.8228 %	●	2 223 556.16 €	5.4125 %	●	* 1 063 908.77 €	27/12/2013
79 908 902.92 €	* 1 217 902.21 €	* 3.0147 %	●	2 186 562.85 €	5.4125 %	●	* 968 660.64 €	27/06/2014
78 974 184.52 €	* 1 337 793.12 €	* 3.2964 %	●	2 196 606.61 €	5.4125 %	●	* 858 813.49 €	29/12/2014
78 011 770.76 €	* 1 394 120.44 €	* 3.5349 %	●	2 134 651.25 €	5.4125 %	●	* 740 530.81 €	29/06/2015
77 019 930.68 €	* 1 437 293.11 €	* 3.6912 %	●	2 107 511.34 €	5.4125 %	●	* 670 218.23 €	28/12/2015
75 998 664.28 €	* 1 458 363.49 €	* 3.7957 %	●	2 079 566.23 €	5.4125 %	●	* 621 202.74 €	27/06/2016
74 946 240.60 €	* 1 483 156.88 €	* 3.8930 %	●	2 062 036.51 €	5.4125 %	●	* 578 879.63 €	27/12/2016
73 862 659.64 €	* 1 496 478.43 €	* 4.0075 %	●	2 021 118.32 €	5.4125 %	●	* 524 639.89 €	27/06/2017
72 746 190.44 €	* 1 521 612.74 €	* 4.1148 %	●	2 001 505.34 €	5.4125 %	●	* 479 892.60 €	27/12/2017
71 596 833.00 €	* 1 519 405.25 €	* 4.1977 %	●	1 959 118.06 €	5.4125 %	●	* 439 712.81 €	27/06/2018
70 412 856.36 €	* 1 519 128.40 €	* 4.2442 %	●	1 937 307.06 €	5.4125 %	●	* 418 178.66 €	27/12/2018
69 193 395.04 €	* 1 493 459.70 €	* 4.2693 %	●	1 893 352.32 €	5.4125 %	●	* 399 892.62 €	27/06/2019
67 936 718.08 €	* 1 485 423.63 €	* 4.3013 %	●	1 869 179.72 €	5.4125 %	●	* 383 756.09 €	27/12/2019
66 642 825.48 €	* 1 491 527.14 €	* 4.3552 %	●	1 853 619.28 €	5.4125 %	●	* 362 092.14 €	29/06/2020
65 309 986.28 €	* 1 459 746.88 €	* 4.4211 %	●	1 787 089.85 €	5.4125 %	●	* 327 342.97 €	28/12/2020
63 937 335.00 €	* 1 449 000.28 €	* 4.4828 %	●	1 749 529.73 €	5.4125 %	●	* 300 529.45 €	28/06/2021
62 523 140.68 €	* 1 432 012.13 €	* 4.5304 %	●	1 710 832.86 €	5.4125 %	●	* 278 820.73 €	27/12/2021
61 066 537.84 €	* 1 407 711.68 €	* 4.5598 %	●	1 670 975.55 €	5.4125 %	●	* 263 263.87 €	27/06/2022

59 566 661.00 €	* 1 382 988.76 €	* 4.5674 %		1 638 889.81 €	5.4125 %		* 255 901.05 €	27/12/2022
58 021 779.20 €	* 1 336 380.47 €	* 4.5559 %		1 587 661.23 €	5.4125 %		* 251 280.76 €	27/06/2023
56 430 161.48 €	* 1 298 995.11 €	* 4.5284 %		1 552 593.60 €	5.4125 %		* 253 598.49 €	27/12/2023
54 790 942.36 €	* 1 251 035.06 €	* 4.4917 %		1 507 492.88 €	5.4125 %		* 256 457.82 €	27/06/2024
53 102 390.88 €	* 1 200 071.88 €	* 4.4457 %		1 461 034.84 €	5.4125 %		* 260 962.96 €	27/12/2024
51 363 641.56 €	* 1 141 152.89 €	* 4.3946 %		1 405 473.31 €	5.4125 %		* 264 320.42 €	27/06/2025
49 572 097.96 €	* 1 104 239.70 €	* 4.3347 %		1 378 810.04 €	5.4125 %		* 274 570.34 €	29/12/2025
47 726 894.60 €	* 1 030 038.24 €	* 4.2690 %		1 305 960.30 €	5.4125 %		* 275 922.06 €	29/06/2026
45 826 300.52 €	* 971 913.82 €	* 4.1951 %		1 253 953.97 €	5.4125 %		* 282 040.15 €	28/12/2026
43 869 450.24 €	* 913 042.39 €	* 4.1168 %		1 200 408.30 €	5.4125 %		* 287 365.91 €	28/06/2027
41 853 747.32 €	* 853 183.49 €	* 4.0322 %		1 145 252.23 €	5.4125 %		* 292 068.74 €	27/12/2027
39 777 460.80 €	* 797 504.35 €	* 3.9441 %		1 094 418.83 €	5.4125 %		* 296 914.48 €	27/06/2028
37 638 859.72 €	* 737 081.48 €	* 3.8524 %		1 035 578.34 €	5.4125 %		* 298 496.86 €	27/12/2028
35 436 213.12 €	* 673 530.52 €	* 3.7596 %		969 647.99 €	5.4125 %		* 296 117.47 €	27/06/2029
33 166 924.56 €	* 617 496.93 €	* 3.6625 %		912 539.56 €	5.4125 %		* 295 042.63 €	27/12/2029
30 830 128.56 €	* 556 237.76 €	* 3.5688 %		843 610.80 €	5.4125 %		* 287 373.04 €	27/06/2030
28 423 228.68 €	* 501 574.44 €	* 3.4715 %		782 023.69 €	5.4125 %		* 280 449.25 €	27/12/2030
25 943 628.48 €	* 443 044.48 €	* 3.3779 %		709 900.55 €	5.4125 %		* 266 856.07 €	27/06/2031
23 389 597.00 €	* 394 740.30 €	* 3.2841 %		650 563.77 €	5.4125 %		* 255 823.47 €	29/12/2031
20 759 403.28 €	* 335 177.44 €	* 3.1937 %		568 043.59 €	5.4125 %		* 232 866.15 €	28/06/2032
18 050 450.88 €	* 283 269.92 €	* 3.1042 %		493 918.00 €	5.4125 %		* 210 648.08 €	27/12/2032
15 260 143.36 €	* 232 899.75 €	* 3.0188 %		417 566.27 €	5.4125 %		* 184 666.52 €	27/06/2033
12 385 884.28 €	* 184 973.18 €	* 2.9379 %		340 779.54 €	5.4125 %		* 155 806.36 €	27/12/2033
9 425 077.20 €	* 136 387.03 €	* 2.8623 %		257 900.22 €	5.4125 %		* 121 513.19 €	27/06/2034
6 375 991.16 €	* 90 514.40 €	* 2.7927 %		175 426.10 €	5.4125 %		* 84 911.70 €	27/12/2034
3 235 164.24 €	* 44 656.93 €	* 2.7304 %		88 524.43 €	5.4125 %		* 43 867.50 €	27/06/2035
	* 60 904 640.68 €			* 79 793 403.12 €			* 18 888 762.44 €	

Swap-05-Dexia-Crediop

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	11 925 450.00 €	Data di incasso :	31/12/2005	Data di fine :	25/09/2023
Valuta di origine :	€	debito residuo	8 612 825.00 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	swap-05	Istituto :	Dexia Crediop
-------------------	---	----------------------	---------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	8 612 825.00 €	Periodicità d'ammortamento	Semestrale
Tasso di progressività	-	Durata residua (anno)	12.73 anni	Valorizzazione	* 794 263.47 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	24/09/2012		Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
24/09/2012	25/09/2023		5.4125 %

Dexia Crediop pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	25/09/2023		Euribor 06 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	24/03/2011	Data d'inizio	24/09/2010	Data di fine	24/03/2011
Data di fixing	22/09/2010	Valore del tasso	1.9000 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	181	Nozionale	8 612 825.00 €	Interessi periodo	82 276.40 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	24/03/2011	Data d'inizio	24/09/2010	Data di fine	24/03/2011
Data di fixing	22/09/2010	Valore di tasso	1.1380 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	181	Nozionale	8 612 825.00 €	Interessi periodo	49 279.24 €

Netting

Data	24/03/2011	Senso	Pagate	Ammontare	32 997.16 €
------	------------	-------	--------	-----------	-------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
5.4125 %			exact/360	0.0000 %	5.4125 %
Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.2380 %
Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.9000 %

Scadenzario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
11 925 450.00 €	72 503.75 €	2.6370 %		72 503.75 €	2.6370 %		0.00 €	24/03/2006
11 594 187.50 €	172 487.69 €	2.8950 %		172 487.69 €	2.8950 %		0.00 €	25/09/2006
11 262 925.00 €	202 821.50 €	3.5620 %		202 821.50 €	3.5620 %		0.00 €	26/03/2007


10 931 662.50 €	221 780.96 €	4.0130 %		221 780.96 €	4.0130 %		0.00 €	24/09/2007
10 600 400.00 €	254 446.70 €	4.7220 %		254 446.70 €	4.7220 %		0.00 €	25/03/2008
10 269 137.50 €	243 310.95 €	4.6610 %		243 310.95 €	4.6610 %		0.00 €	24/09/2008
9 937 875.00 €	261 918.77 €	5.2420 %		261 918.77 €	5.2420 %		0.00 €	24/03/2009
9 606 612.50 €	84 600.10 €	1.7230 %		93 290.88 €	1.9000 %		8 690.78 €	24/09/2009
9 275 350.00 €	47 986.80 €	1.0290 %		88 605.36 €	1.9000 %		40 618.56 €	24/03/2010
8 944 087.50 €	43 428.51 €	0.9500 %		86 857.03 €	1.9000 %		43 428.52 €	24/09/2010
8 612 825.00 €	49 279.24 €	1.1380 %		82 276.40 €	1.9000 %		32 997.16 €	24/03/2011
8 281 562.50 €	* 54 723.46 €	* 1.2789 %		* 81 297.34 €	* 1.9000 %		* 26 573.88 €	26/09/2011
7 950 300.00 €	* 58 719.86 €	* 1.4609 %		* 76 367.05 €	* 1.9000 %		* 17 647.19 €	26/03/2012
7 619 037.50 €	* 66 652.15 €	* 1.7304 %		* 73 185.09 €	* 1.9000 %		* 6 532.94 €	24/09/2012
7 287 775.00 €	* 74 472.01 €	* 2.0213 %		199 416.80 €	5.4125 %		* 124 944.79 €	25/03/2013
6 956 512.50 €	* 95 940.17 €	* 2.7131 %		191 398.30 €	5.4125 %		* 95 458.13 €	24/09/2013
6 625 250.00 €	* 96 260.55 €	* 2.8898 %		180 291.92 €	5.4125 %		* 84 031.37 €	24/03/2014
6 293 987.50 €	* 101 289.41 €	* 3.1486 %		174 116.17 €	5.4125 %		* 72 826.76 €	24/09/2014
5 962 725.00 €	* 102 572.93 €	* 3.4215 %		162 262.72 €	5.4125 %		* 59 689.79 €	24/03/2015
5 631 462.50 €	* 104 182.71 €	* 3.6196 %		155 788.15 €	5.4125 %		* 51 605.44 €	24/09/2015
5 300 200.00 €	* 100 359.34 €	* 3.7454 %		145 030.40 €	5.4125 %		* 44 671.06 €	24/03/2016
4 968 937.50 €	* 98 651.86 €	* 3.8427 %		138 954.27 €	5.4125 %		* 40 302.41 €	26/09/2016
4 637 675.00 €	* 91 045.18 €	* 3.9483 %		124 809.82 €	5.4125 %		* 33 764.64 €	24/03/2017
4 306 412.50 €	* 89 923.03 €	* 4.0634 %		119 779.57 €	5.4125 %		* 29 856.54 €	25/09/2017
3 975 150.00 €	* 83 586.24 €	* 4.1592 %		108 772.80 €	5.4125 %		* 25 186.56 €	26/03/2018
3 643 887.50 €	* 77 840.30 €	* 4.2254 %		99 708.40 €	5.4125 %		* 21 868.10 €	24/09/2018
3 312 625.00 €	* 71 287.85 €	* 4.2567 %		90 644.00 €	5.4125 %		* 19 356.15 €	25/03/2019
2 981 362.50 €	* 64 910.90 €	* 4.2831 %		82 027.84 €	5.4125 %		* 17 116.94 €	24/09/2019
2 650 100.00 €	* 57 935.05 €	* 4.3242 %		72 515.20 €	5.4125 %		* 14 580.15 €	24/03/2020
2 318 837.50 €	* 51 988.67 €	* 4.3865 %		64 148.06 €	5.4125 %		* 12 159.39 €	24/09/2020
1 987 575.00 €	* 44 488.50 €	* 4.4519 %		54 087.57 €	5.4125 %		* 9 599.07 €	24/03/2021
1 656 312.50 €	* 38 169.16 €	* 4.5087 %		45 820.04 €	5.4125 %		* 7 650.88 €	24/09/2021
1 325 050.00 €	* 30 291.28 €	* 4.5468 %		36 058.38 €	5.4125 %		* 5 767.10 €	24/03/2022
993 787.50 €	* 23 447.77 €	* 4.5666 %		27 790.85 €	5.4125 %		* 4 343.08 €	26/09/2022
662 525.00 €	* 15 032.83 €	* 4.5634 %		17 829.97 €	5.4125 %		* 2 797.14 €	24/03/2023
331 262.50 €	* 7 735.92 €	* 4.5443 %		9 213.81 €	5.4125 %		* 1 477.89 €	25/09/2023
	* 3 356 072.10 €			* 4 311 614.51 €			* 955 542.41 €	

Swap-05-Merrill-Lynch

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	11 925 450.00 €	Data di incasso :	31/12/2005	Data di fine :	25/09/2023
Valuta di origine :	€	debito residuo	8 612 825.00 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	Merill-Lynch-Tranche-I	Istituto :	Merrill Lynch
-------------------	---	----------------------	------------------------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	8 612 825.00 €	Periodicità d'ammortamento	Semestrale
Tasso di progressività	-	Durata residua (anno)	12.73 anni	Valorizzazione	* 794 263.47 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	24/09/2012		Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
24/09/2012	25/09/2023		5.4125 %

Merrill Lynch pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	25/09/2023		Euribor 06 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	24/03/2011	Data d'inizio	24/09/2010	Data di fine	24/03/2011
Data di fixing	22/09/2010	Valore del tasso	1.9000 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	181	Nozionale	8 612 825.00 €	Interessi periodo	82 276.40 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	24/03/2011	Data d'inizio	24/09/2010	Data di fine	24/03/2011
Data di fixing	22/09/2010	Valore di tasso	1.1380 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	181	Nozionale	8 612 825.00 €	Interessi periodo	49 279.24 €

Netting

Data	24/03/2011	Senso	Pagate	Ammontare	32 997.16 €
------	------------	-------	--------	-----------	-------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
5.4125 %			exact/360	0.0000 %	5.4125 %
Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.2380 %
Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.9000 %

Scadenzario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
11 925 450.00 €	72 503.75 €	2.6370 %		72 503.75 €	2.6370 %		0.00 €	24/03/2006
11 594 187.50 €	172 487.69 €	2.8950 %		172 487.69 €	2.8950 %		0.00 €	25/09/2006
11 262 925.00 €	202 821.50 €	3.5620 %		202 821.50 €	3.5620 %		0.00 €	26/03/2007
10 931 662.50 €	221 780.96 €	4.0130 %		221 780.96 €	4.0130 %		0.00 €	24/09/2007
10 600 400.00 €	254 446.70 €	4.7220 %		254 446.70 €	4.7220 %		0.00 €	25/03/2008

10 269 137.50 €	243 310.95 €	4.6610 %		243 310.95 €	4.6610 %		0.00 €	24/09/2008
9 937 875.00 €	261 918.77 €	5.2420 %		261 918.77 €	5.2420 %		0.00 €	24/03/2009
9 606 612.50 €	84 600.10 €	1.7230 %		93 290.88 €	1.9000 %		8 690.78 €	24/09/2009
9 275 350.00 €	47 986.80 €	1.0290 %		88 605.36 €	1.9000 %		40 618.56 €	24/03/2010
8 944 087.50 €	43 428.51 €	0.9500 %		86 857.03 €	1.9000 %		43 428.52 €	24/09/2010
8 612 825.00 €	49 279.24 €	1.1380 %		82 276.40 €	1.9000 %		32 997.16 €	24/03/2011
8 281 562.50 €	* 54 723.46 €	* 1.2789 %		* 81 297.34 €	* 1.9000 %		* 26 573.88 €	26/09/2011
7 950 300.00 €	* 58 719.86 €	* 1.4609 %		* 76 367.05 €	* 1.9000 %		* 17 647.19 €	26/03/2012
7 619 037.50 €	* 66 652.15 €	* 1.7304 %		* 73 185.09 €	* 1.9000 %		* 6 532.94 €	24/09/2012
7 287 775.00 €	* 74 472.01 €	* 2.0213 %		199 416.80 €	5.4125 %		* 124 944.79 €	25/03/2013
6 956 512.50 €	* 95 940.17 €	* 2.7131 %		191 398.30 €	5.4125 %		* 95 458.13 €	24/09/2013
6 625 250.00 €	* 96 260.55 €	* 2.8898 %		180 291.92 €	5.4125 %		* 84 031.37 €	24/03/2014
6 293 987.50 €	* 101 289.41 €	* 3.1486 %		174 116.17 €	5.4125 %		* 72 826.76 €	24/09/2014
5 962 725.00 €	* 102 572.93 €	* 3.4215 %		162 262.72 €	5.4125 %		* 59 689.79 €	24/03/2015
5 631 462.50 €	* 104 182.71 €	* 3.6196 %		155 788.15 €	5.4125 %		* 51 605.44 €	24/09/2015
5 300 200.00 €	* 100 359.34 €	* 3.7454 %		145 030.40 €	5.4125 %		* 44 671.06 €	24/03/2016
4 968 937.50 €	* 98 651.86 €	* 3.8427 %		138 954.27 €	5.4125 %		* 40 302.41 €	26/09/2016
4 637 675.00 €	* 91 045.18 €	* 3.9483 %		124 809.82 €	5.4125 %		* 33 764.64 €	24/03/2017
4 306 412.50 €	* 89 923.03 €	* 4.0634 %		119 779.57 €	5.4125 %		* 29 856.54 €	25/09/2017
3 975 150.00 €	* 83 586.24 €	* 4.1592 %		108 772.80 €	5.4125 %		* 25 186.56 €	26/03/2018
3 643 887.50 €	* 77 840.30 €	* 4.2254 %		99 708.40 €	5.4125 %		* 21 868.10 €	24/09/2018
3 312 625.00 €	* 71 287.85 €	* 4.2567 %		90 644.00 €	5.4125 %		* 19 356.15 €	25/03/2019
2 981 362.50 €	* 64 910.90 €	* 4.2831 %		82 027.84 €	5.4125 %		* 17 116.94 €	24/09/2019
2 650 100.00 €	* 57 935.05 €	* 4.3242 %		72 515.20 €	5.4125 %		* 14 580.15 €	24/03/2020
2 318 837.50 €	* 51 988.67 €	* 4.3865 %		64 148.06 €	5.4125 %		* 12 159.39 €	24/09/2020
1 987 575.00 €	* 44 488.50 €	* 4.4519 %		54 087.57 €	5.4125 %		* 9 599.07 €	24/03/2021
1 656 312.50 €	* 38 169.16 €	* 4.5087 %		45 820.04 €	5.4125 %		* 7 650.88 €	24/09/2021
1 325 050.00 €	* 30 291.28 €	* 4.5468 %		36 058.38 €	5.4125 %		* 5 767.10 €	24/03/2022
993 787.50 €	* 23 447.77 €	* 4.5666 %		27 790.85 €	5.4125 %		* 4 343.08 €	26/09/2022
662 525.00 €	* 15 032.83 €	* 4.5634 %		17 829.97 €	5.4125 %		* 2 797.14 €	24/03/2023
331 262.50 €	* 7 735.92 €	* 4.5443 %		9 213.81 €	5.4125 %		* 1 477.89 €	25/09/2023
	* 3 356 072.10 €			* 4 311 614.51 €			* 955 542.41 €	

Swap-06-Dexia-Crediop

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	7 324 450.00 €	Data di incasso :	31/12/2005	Data di fine :	16/12/2022
Valuta di origine :	€	debito residuo	5 170 200.00 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	swap-06	Istituto :	Dexia Crediop
-------------------	---	----------------------	---------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	5 170 200.00 €	Periodicità d'ammortamento	Semestrale
Tasso di progressività	-	Durata residua (anno)	11.96 anni	Valorizzazione	* 426 472.95 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	17/12/2012		Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
17/12/2012	16/12/2022		5.4125 %

Dexia Crediop pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	16/12/2022		Euribor 06 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	16/06/2011	Data d'inizio	16/12/2010	Data di fine	16/06/2011
Data di fixing	14/12/2010	Valore del tasso	1.9000 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	5 170 200.00 €	Interessi periodo	49 662.64 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	16/06/2011	Data d'inizio	16/12/2010	Data di fine	16/06/2011
Data di fixing	14/12/2010	Valore di tasso	1.2540 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	5 170 200.00 €	Interessi periodo	32 777.34 €







Netting

Data	16/06/2011	Senso	Pagate	Ammontare	16 885.30 €
------	------------	-------	--------	-----------	-------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
5.4125 %			exact/360	0.0000 %	5.4125 %
Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.2380 %
Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.9000 %

Scadenzario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
7 324 450.00 €	89 598.17 €	2.6370 %		89 598.17 €	2.6370 %		0.00 €	16/06/2006
7 109 025.00 €	113 616.04 €	3.1100 %		113 616.04 €	3.1100 %		0.00 €	18/12/2006
6 893 600.00 €	132 224.61 €	3.7940 %		132 224.61 €	3.7940 %		0.00 €	18/06/2007

6 678 175.00 €	144 602.15 €	4.2830 %		144 602.15 €	4.2830 %		0.00 €	17/12/2007
6 462 750.00 €	160 031.33 €	4.8980 %		160 031.33 €	4.8980 %		0.00 €	16/06/2008
6 247 325.00 €	162 882.86 €	5.1290 %		162 882.86 €	5.1290 %		0.00 €	16/12/2008
6 031 900.00 €	102 736.33 €	3.3690 %		102 736.33 €	3.3690 %		0.00 €	16/06/2009
5 816 475.00 €	43 700.15 €	1.4780 %		56 177.45 €	1.9000 %		12 477.30 €	16/12/2009
5 601 050.00 €	28 288.10 €	0.9990 %		53 801.20 €	1.9000 %		25 513.10 €	16/06/2010
5 385 625.00 €	27 513.81 €	1.0050 %		52 016.16 €	1.9000 %		24 502.35 €	16/12/2010
5 170 200.00 €	32 777.34 €	1.2540 %		49 662.64 €	1.9000 %		16 885.30 €	16/06/2011
4 954 775.00 €	* 33 070.46 €	* 1.3130 %		* 47 854.87 €	* 1.9000 %		* 14 784.41 €	16/12/2011
4 739 350.00 €	* 37 565.45 €	* 1.5424 %		* 46 274.49 €	* 1.9000 %		* 8 709.04 €	18/06/2012
4 523 925.00 €	* 42 582.35 €	* 1.8619 %		* 43 454.81 €	* 1.9000 %		* 872.46 €	17/12/2012
4 308 500.00 €	* 50 262.84 €	* 2.3076 %		117 894.32 €	5.4125 %		* 67 631.48 €	17/06/2013
4 093 075.00 €	* 58 314.45 €	* 2.8181 %		111 999.61 €	5.4125 %		* 53 685.16 €	16/12/2013
3 877 650.00 €	* 58 784.74 €	* 2.9987 %		106 104.89 €	5.4125 %		* 47 320.15 €	16/06/2014
3 662 225.00 €	* 61 002.44 €	* 3.2768 %		100 760.78 €	5.4125 %		* 39 758.34 €	16/12/2014
3 446 800.00 €	* 61 383.76 €	* 3.5226 %		94 315.46 €	5.4125 %		* 32 931.70 €	16/06/2015
3 231 375.00 €	* 60 489.44 €	* 3.6825 %		88 906.57 €	5.4125 %		* 28 417.13 €	16/12/2015
3 015 950.00 €	* 58 120.02 €	* 3.7910 %		82 979.47 €	5.4125 %		* 24 859.45 €	16/06/2016
2 800 525.00 €	* 55 347.35 €	* 3.8878 %		77 052.36 €	5.4125 %		* 21 705.01 €	16/12/2016
2 585 100.00 €	* 52 308.29 €	* 4.0024 %		70 736.59 €	5.4125 %		* 18 428.30 €	16/06/2017
2 369 675.00 €	* 50 048.88 €	* 4.1099 %		65 910.70 €	5.4125 %		* 15 861.82 €	18/12/2017
2 154 250.00 €	* 45 689.01 €	* 4.1951 %		58 947.16 €	5.4125 %		* 13 258.15 €	18/06/2018
1 938 825.00 €	* 41 582.28 €	* 4.2423 %		53 052.45 €	5.4125 %		* 11 470.17 €	17/12/2018
1 723 400.00 €	* 37 188.28 €	* 4.2683 %		47 157.73 €	5.4125 %		* 9 969.45 €	17/06/2019
1 507 975.00 €	* 32 770.78 €	* 4.2986 %		41 263.01 €	5.4125 %		* 8 492.23 €	16/12/2019
1 292 550.00 €	* 28 591.04 €	* 4.3514 %		35 562.63 €	5.4125 %		* 6 971.59 €	16/06/2020
1 077 125.00 €	* 24 181.42 €	* 4.4164 %		29 635.52 €	5.4125 %		* 5 454.10 €	16/12/2020
861 700.00 €	* 19 516.36 €	* 4.4800 %		23 578.86 €	5.4125 %		* 4 062.50 €	16/06/2021
646 275.00 €	* 14 876.38 €	* 4.5283 %		17 781.31 €	5.4125 %		* 2 904.93 €	16/12/2021
430 850.00 €	* 9 929.89 €	* 4.5588 %		11 789.43 €	5.4125 %		* 1 859.54 €	16/06/2022
215 425.00 €	* 5 001.76 €	* 4.5675 %		5 927.10 €	5.4125 %		* 925.34 €	16/12/2022
	* 1 976 578.56 €			* 2 496 289.06 €			* 519 710.50 €	

Swap-06-Merrill-Lynch

Caratteristiche generali

Nozionale iniziale :	7 324 450.00 €	Data di incasso :	31/12/2005	Data di fine :	16/12/2022
Valuta di origine :	€	debito residuo	5 170 200.00 €	Vedere lo scadenziario	

Prestatore

Istituto :		Riferimento :	Merrill-Lynch-Tranche-II	Istituto :	Merrill Lynch
-------------------	---	----------------------	--------------------------	-------------------	---------------

Ammortamento, durata e valorizzazione

Ammortamento	Italiano (lin.)	Impiego nozionale	5 170 200.00 €	Periodicità d'ammortamento	Semestrale
Tasso di progressività	-	Durata residua (anno)	11.96 anni	Valorizzazione	* 426 472.95 €

Provincia di Torino - Debito globale pagato

Tipo	Tasso fisso	Tasso di riferimento	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base di tasso	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba pagatrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	17/12/2012		Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M
17/12/2012	16/12/2022		5.4125 %

Merrill Lynch pagato

Tipo	Tasso variabile	Tasso di riferimento	Euribor 06 M	Periodo	Semestrale
Base	exact/360	Margine	0.0000 %	Fixing	G-2 Giorno lavorativo
Riferimento	InAdvance	Arrotondato	due decimali	Valuta	€

Regole sulla gamba ricevitrice

Data d'inizio	Data di fine	Condizione	Risultante
31/12/2005	16/12/2022		Euribor 06 M

Prossima Scadenza Pagatrice

Data di prossima scadenza	16/06/2011	Data d'inizio	16/12/2010	Data di fine	16/06/2011
Data di fixing	14/12/2010	Valore del tasso	1.9000 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	5 170 200.00 €	Interessi periodo	49 662.64 €

Prossima Scadenza Ricevitrice

Data di prossima scadenza	16/06/2011	Data d'inizio	16/12/2010	Data di fine	16/06/2011
Data di fixing	14/12/2010	Valore di tasso	1.2540 %	Tipo	conosciuta
Numero di giorni	182	Nozionale	5 170 200.00 €	Interessi periodo	32 777.34 €





Netting

Data	16/06/2011	Senso	Pagate	Ammontare	16 885.30 €
-------------	------------	--------------	--------	------------------	-------------

Indici associati al mutuo

Indice	Rif Fixing	Aggiustamento del fixing	Base di tasso	Margine	Valore attuale
5.4125 %			exact/360	0.0000 %	5.4125 %
Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.2380 %
Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	In advance	G-2 Giorno lavorativo	exact/360	0.0000 %	1.9000 %

Scadenzario

Nozionale	Interessi ricevuti	Tasso di interesse ricevuto	Tipo ricevuto	Interessi pagati	Tasso di interesse pagato	Tipo pagato	Rata complessiva	Data cedola
7 324 450.00 €	89 598.17 €	2.6370 %		89 598.17 €	2.6370 %		0.00 €	16/06/2006
7 109 025.00 €	113 616.04 €	3.1100 %		113 616.04 €	3.1100 %		0.00 €	18/12/2006

6 893 600.00 €	132 224.61 €	3.7940 %		132 224.61 €	3.7940 %		0.00 €	18/06/2007
6 678 175.00 €	144 602.15 €	4.2830 %		144 602.15 €	4.2830 %		0.00 €	17/12/2007
6 462 750.00 €	160 031.33 €	4.8980 %		160 031.33 €	4.8980 %		0.00 €	16/06/2008
6 247 325.00 €	162 882.86 €	5.1290 %		162 882.86 €	5.1290 %		0.00 €	16/12/2008
6 031 900.00 €	102 736.33 €	3.3690 %		102 736.33 €	3.3690 %		0.00 €	16/06/2009
5 816 475.00 €	43 700.15 €	1.4780 %		56 177.45 €	1.9000 %		12 477.30 €	16/12/2009
5 601 050.00 €	28 288.10 €	0.9990 %		53 801.20 €	1.9000 %		25 513.10 €	16/06/2010
5 385 625.00 €	27 513.81 €	1.0050 %		52 016.16 €	1.9000 %		24 502.35 €	16/12/2010
5 170 200.00 €	32 777.34 €	1.2540 %		49 662.64 €	1.9000 %		16 885.30 €	16/06/2011
4 954 775.00 €	* 33 070.46 €	* 1.3130 %		* 47 854.87 €	* 1.9000 %		* 14 784.41 €	16/12/2011
4 739 350.00 €	* 37 565.45 €	* 1.5424 %		* 46 274.49 €	* 1.9000 %		* 8 709.04 €	18/06/2012
4 523 925.00 €	* 42 582.35 €	* 1.8619 %		* 43 454.81 €	* 1.9000 %		* 872.46 €	17/12/2012
4 308 500.00 €	* 50 262.84 €	* 2.3076 %		117 894.32 €	5.4125 %		* 67 631.48 €	17/06/2013
4 093 075.00 €	* 58 314.45 €	* 2.8181 %		111 999.61 €	5.4125 %		* 53 685.16 €	16/12/2013
3 877 650.00 €	* 58 784.74 €	* 2.9987 %		106 104.89 €	5.4125 %		* 47 320.15 €	16/06/2014
3 662 225.00 €	* 61 002.44 €	* 3.2768 %		100 760.78 €	5.4125 %		* 39 758.34 €	16/12/2014
3 446 800.00 €	* 61 383.76 €	* 3.5226 %		94 315.46 €	5.4125 %		* 32 931.70 €	16/06/2015
3 231 375.00 €	* 60 489.44 €	* 3.6825 %		88 906.57 €	5.4125 %		* 28 417.13 €	16/12/2015
3 015 950.00 €	* 58 120.02 €	* 3.7910 %		82 979.47 €	5.4125 %		* 24 859.45 €	16/06/2016
2 800 525.00 €	* 55 347.35 €	* 3.8878 %		77 052.36 €	5.4125 %		* 21 705.01 €	16/12/2016
2 585 100.00 €	* 52 308.29 €	* 4.0024 %		70 736.59 €	5.4125 %		* 18 428.30 €	16/06/2017
2 369 675.00 €	* 50 048.88 €	* 4.1099 %		65 910.70 €	5.4125 %		* 15 861.82 €	18/12/2017
2 154 250.00 €	* 45 689.01 €	* 4.1951 %		58 947.16 €	5.4125 %		* 13 258.15 €	18/06/2018
1 938 825.00 €	* 41 582.28 €	* 4.2423 %		53 052.45 €	5.4125 %		* 11 470.17 €	17/12/2018
1 723 400.00 €	* 37 188.28 €	* 4.2683 %		47 157.73 €	5.4125 %		* 9 969.45 €	17/06/2019
1 507 975.00 €	* 32 770.78 €	* 4.2986 %		41 263.01 €	5.4125 %		* 8 492.23 €	16/12/2019
1 292 550.00 €	* 28 591.04 €	* 4.3514 %		35 562.63 €	5.4125 %		* 6 971.59 €	16/06/2020
1 077 125.00 €	* 24 181.42 €	* 4.4164 %		29 635.52 €	5.4125 %		* 5 454.10 €	16/12/2020
861 700.00 €	* 19 516.36 €	* 4.4800 %		23 578.86 €	5.4125 %		* 4 062.50 €	16/06/2021
646 275.00 €	* 14 876.38 €	* 4.5283 %		17 781.31 €	5.4125 %		* 2 904.93 €	16/12/2021
430 850.00 €	* 9 929.89 €	* 4.5588 %		11 789.43 €	5.4125 %		* 1 859.54 €	16/06/2022
215 425.00 €	* 5 001.76 €	* 4.5675 %		5 927.10 €	5.4125 %		* 925.34 €	16/12/2022
	* 1 976 578.56 €			* 2 496 289.06 €			* 519 710.50 €	

Andamento mensile (anno 2010) del MARK TO MARKET

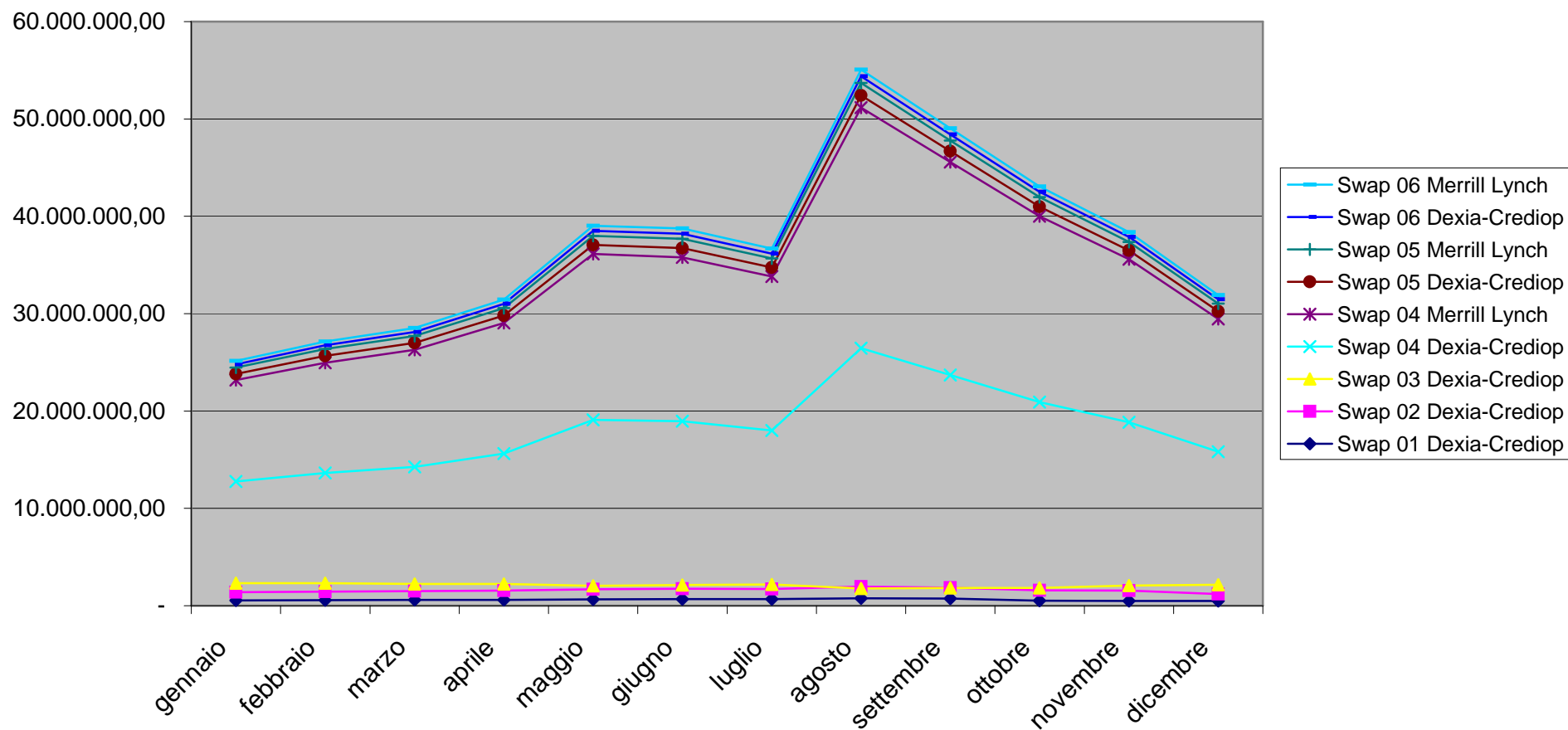
Dalle tabelle in questione emerge il valore del “Mark to market”, relativo ad ogni singola operazione corrispondente al valore riportato nell’ultima colonna denominata “valorizzazione”.

Nelle pagine che seguono vengono analizzati SINTETITICAMENTE ed ANALITICAMENTE i valori di ogni singola operazione: oltre ai dati relativi al “Mark to Market” vengono indicati i flussi presunti in uscita ed in entrata alla prossima scadenza convenuta nel contratto di swap. I flussi in uscita sono riportati nella riga “Interessi periodo” della “Prossima scadenza pagatrice”; i flussi in entrata sono analogamente rappresentati in corrispondenza della riga “Interessi periodo” della “Prossima scadenza ricevitrice”. Viene altresì riportato il “Netting”: tale valore identifica, con una proiezione effettuata al 31 dicembre 2010 e riferito alla prima scadenza del 2011, il differenziale a credito o a debito della Provincia. Nella successiva tabella riferita ad ogni singola operazione di swap e intestata “Scadenziario” viene illustrato l’ammontare degli interessi pagati/da pagare e di quelli ricevuti/da ricevere dalla data di stipulazione del contratto di swap alla relativa scadenza naturale. Il totale finale identifica sostanzialmente alla data del 31.12.2010 quale sarà nel complesso l’ammontare dei benefici in entrata (interessi ricevuti) ed il costo dell’operazione stessa (interessi pagati) per tutta la durata naturale del contratto. Relativamente ad ogni singolo esercizio, la differenza negativa tra “interessi ricevuti” ed “interessi pagati” identifica l’effettivo onere finale di ogni singola operazione di swap.

SINTESI dei valori del MARK TO MARKET presi all'ultimo giorno di ogni mese

ANNO 2010	Swap 01 Dexia- Crediop	Swap 02 Dexia-Crediop	Swap 03 Dexia- Crediop	Swap 04 Dexia- Crediop	Swap 04 Merrill Lynch	Swap 05 Dexia-Crediop	Swap 05 Merrill Lynch	Swap 06 Dexia- Crediop	Swap 06 Merrill Lynch	Totale
gennaio	541.936,04	838.860,36	950.175,94	10.419.840,57	10.419.840,57	640.951,16	640.951,16	342.303,14	342.303,14	25.137.162,08
febbraio	569.330,27	882.083,89	862.073,92	11.322.311,71	11.322.311,71	704.677,50	704.677,50	377.779,32	377.779,32	27.123.025,14
marzo	588.815,59	910.514,47	740.950,08	12.025.192,58	12.025.192,58	714.080,14	714.080,14	405.645,00	405.645,00	28.530.115,58
aprile	612.535,50	946.552,98	675.644,26	13.403.027,71	13.403.027,71	770.617,40	770.617,40	437.658,89	437.658,89	31.457.340,74
maggio	665.791,12	1.025.409,70	342.540,25	17.056.527,55	17.056.527,55	920.724,14	920.724,14	524.148,94	524.148,94	39.036.542,33
giugno	687.885,45	1.057.704,02	391.204,50	16.824.073,97	16.824.073,97	958.631,15	958.631,15	519.897,49	519.897,49	38.741.999,19
luglio	675.958,73	1.039.337,62	453.806,84	15.824.340,44	15.824.340,44	927.794,88	927.794,88	502.307,37	502.307,37	36.677.988,57
agosto	775.283,47	1.180.634,35	- 190.853,92	24.703.011,91	24.703.011,91	1.260.255,39	1.260.255,39	684.484,09	684.484,09	55.060.566,68
settembre	739.949,27	1.125.956,43	- 36.521,22	21.873.753,65	21.873.753,65	1.107.218,85	1.107.218,85	622.544,38	622.544,38	49.036.418,24
ottobre	524.533,61	1.066.644,08	229.864,95	19.094.546,54	19.094.546,54	975.883,47	975.883,47	550.843,61	550.843,61	43.063.589,88
novembre	503.325,62	1.044.198,48	538.780,42	16.757.361,04	16.757.361,04	886.832,67	886.832,67	502.853,89	502.853,89	38.380.399,72
dicembre	478.877,14	723.334,04	950.890,10	13.651.814,07	13.651.814,07	794.263,47	794.263,47	426.472,95	426.472,95	31.898.202,26






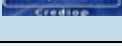
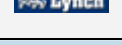

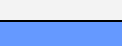
Andamento mensile anno 2010 - MARK TO MARKET








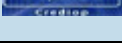
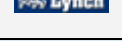

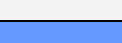
31 gennaio 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.74 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 541 936.04 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.88 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 838 860.36 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 726 466.43 €	15.41 anni	30/06/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 950 175.94 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84.384 300.00 €	25.41 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 10 419 840.57 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.41 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 10 419 840.57 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		9 275 350.00 €	13.65 anni	24/03/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 640 951.16 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		9 275 350.00 €	13.65 anni	24/03/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 640 951.16 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.88 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 342 303.14 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.88 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 342 303.14 €
			262 474 613.20 €					* 25 137 162.08 €










28 febbraio 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.66 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 569 330.27 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.81 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 882 083.89 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 726 466.43 €	15.34 anni	30/06/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 862 073.92 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.33 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 11 322 311.71 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.33 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 11 322 311.71 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		9 275 350.00 €	13.58 anni	24/03/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 704 677.50 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		9 275 350.00 €	13.58 anni	24/03/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 704 677.50 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.80 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 377 779.32 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.80 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 377 779.32 €
			262 474 613.20 €					* 27 123 025.14 €










31 marzo 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.57 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 588 815.59 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.72 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 910 514.47 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 726 466.43 €	15.25 anni	30/06/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 740 950.08 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.24 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 12 025 192.58 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.24 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 12 025 192.58 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.48 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 714 080.14 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.48 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 714 080.14 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.71 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 405 645.00 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.71 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 405 645.00 €
			261 812 088.20 €					* 28 530 115.58 €






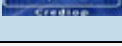
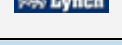

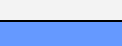
30 aprile 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.49 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 612 535.50 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.64 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 946 552.98 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 726 466.43 €	15.17 anni	30/06/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 675 644.26 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.16 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 13 403 027.71 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.16 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 13 403 027.71 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.40 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 770 617.40 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.40 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 770 617.40 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.63 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 437 658.89 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.63 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 437 658.89 €
			261 812 088.20 €					* 31 457 340.74 €






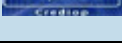
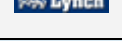

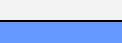
31 maggio 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.40 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 665 791.12 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.55 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 1 025 409.70 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 726 466.43 €	15.08 anni	30/06/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 342 540.25 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.07 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 17 056 527.55 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 384 300.00 €	25.07 anni	28/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 17 056 527.55 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.32 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 920 724.14 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.32 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 920 724.14 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.54 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 524 148.94 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 601 050.00 €	12.54 anni	16/06/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 524 148.94 €
			261 812 088.20 €					* 39 036 542.33 €










30 giugno 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.32 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 687 885.45 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.47 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 1 057 704.02 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 229 264.47 €	15.00 anni	31/12/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 391 204.50 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.99 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 16 824 073.97 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.99 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 16 824 073.97 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.24 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 958 631.15 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.24 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 958 631.15 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.46 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 519 897.49 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.46 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 519 897.49 €
			260 383 788.80 €					* 38 741 999.19 €






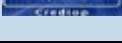
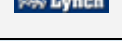

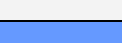
31 luglio 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.24 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 675 958.73 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.38 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 1 039 337.62 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 229 264.47 €	14.91 anni	31/12/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 453 806.84 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.91 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 15 824 340.44 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.91 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 15 824 340.44 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.15 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 927 794.88 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.15 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 927 794.88 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.38 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 502 307.37 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.38 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 502 307.37 €
			260 383 788.80 €					* 36 677 988.57 €






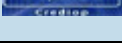
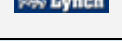

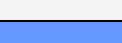
31 agosto 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.15 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 775 283.47 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.30 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 1 180 634.35 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 229 264.47 €	14.83 anni	31/12/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* - 190 853.92 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.82 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 24 703 011.91 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.82 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 24 703 011.91 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.07 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 1 260 255.39 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 944 087.50 €	13.07 anni	24/09/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 1 260 255.39 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.29 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 684 484.09 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.29 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 684 484.09 €
			260 383 788.80 €					* 55 060 566.68 €






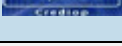
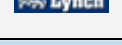

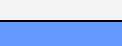
30 settembre 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 648 000.00 €	9.07 anni	26/10/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 739 949.27 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.22 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 1 125 956.43 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 229 264.47 €	14.75 anni	31/12/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* - 36 521.22 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.74 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 21 873 753.65 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.74 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 21 873 753.65 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.99 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 1 107 218.85 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.99 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 1 107 218.85 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.21 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 622 544.38 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.21 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 622 544.38 €
			259 721 263.80 €					* 49 036 418.24 €










31 ottobre 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 183 200.00 €	8.99 anni	26/10/2011	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 524 533.61 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.13 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 1 066 644.08 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 229 264.47 €	14.66 anni	31/12/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 229 864.95 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.66 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 19 094 546.54 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.66 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 19 094 546.54 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.90 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 975 883.47 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.90 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 975 883.47 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.13 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 550 843.61 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.13 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 550 843.61 €
			259 256 463.80 €					* 43 063 589.88 €

30 novembre 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 183 200.00 €	8.91 anni	26/10/2011	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 503 325.62 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		7 578 746.77 €	8.05 anni	19/12/2010	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 1 044 198.48 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		51 229 264.47 €	14.58 anni	31/12/2010	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears)+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 538 780.42 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.58 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 16 757 361.04 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		84 134 176.28 €	24.58 anni	27/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 16 757 361.04 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.82 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 886 832.67 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.82 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 886 832.67 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.04 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 502 853.89 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 385 625.00 €	12.04 anni	16/12/2010	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 502 853.89 €
			259 256 463.80 €					* 38 380 399.72 €

31 dicembre 2010

N° Copertura	Proprietario del mutuo	Banca	Nozionale resid.	Durata resid.	Prossima rata complessiva	Tasso ricevuto	Tasso pagato	Valorizzazione
swap-01-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		4 183 200.00 €	8.82 anni	26/10/2011	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.94% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 478 877.14 €
swap-02-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		6 736 663.79 €	7.97 anni	19/12/2011	Euribor 12 M	Tasso fisso 4.98% con barriera 6% su Euribor 12 M	* 723 334.04 €
swap-03-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		50 718 524.50 €	14.50 anni	30/06/2011	Tasso fisso al 5.55 %	(Euribor 06 M(In arrears))+Collar 4.35/7 su Euribor 06 M(In arrears))+0.75	* 950 890.10 €
swap-04-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		83 884 052.56 €	24.49 anni	27/06/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 13 651 814.07 €
swap-04-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		83 884 052.56 €	24.49 anni	27/06/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 13 651 814.07 €
swap-05-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.73 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 794 263.47 €
swap-05-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		8 612 825.00 €	12.73 anni	24/03/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 794 263.47 €
swap-06-Dexia-Crediop	Provincia di Torino - Debito globale		5 170 200.00 €	11.96 anni	16/06/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 426 472.95 €
swap-06-Merrill-Lynch	Provincia di Torino - Debito globale		5 170 200.00 €	11.96 anni	16/06/2011	Euribor 06 M	Euribor 06 M+Collar 1.9/5.5 su Euribor 06 M	* 426 472.95 €
			256 972 543.41 €					* 31 898 202.26 €