

Polizze DIPIU'
Valore titolo al 31/07/2008

Nome Prodotto	Valore Titolo	Denominazione Emittente		Rating S&P	Rating Moody's
DiPiu' 75	97,6600	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu' 76	116,5900	Titolo Strutturato	Dexia Crediop S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu' 90	94,9231	Titolo Strutturato	SNS Reall Groep N.V.	A-	A3
DiPiu' 92	103,4500	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu' 93	106,4083	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu' 94	102,6700	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu' 96	122,3300	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu' 97	125,4600	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu' 98	127,6300	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu' 99	132,7000	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu' Lido	78,3100	Titolo Strutturato	UBS AG London Branch		Aa2
		Opzione	UBS AG London Branch		Aa2
DiPiu' 100	127,6300	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu' 1001	92,3800	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu' 1002	93,5866	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1003	96,7682	BOND	Bank of America Corporation	AA	Aa2
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu' 1004	76,2735	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu' 1005	99,2077	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu' 1006	100,5370	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1007	90,6604	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
		SWAP	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiu' 1008	90,6506	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
		SWAP	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiu' 1009	88,0100	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu' 101	131,1600	BOND	Trees Sa		Aaa
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu' 1010	79,0100	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu' 1011	89,7835	BOND	J.P. Morgan Chase & Co.	AA-	Aa2
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu' 1012	95,3154	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1013	91,9035	BOND	J.P. Morgan Chase & Co.	AA-	Aa2
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1014	87,6429	BOND	Fortis Finance N.V.		A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1015	118,3400	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu' 1016	85,8029	BOND	Fortis Finance N.V.		A1
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu' 1018	95,1967	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1019	85,5329	BOND	Fortis Finance N.V.		A1
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu' 102	124,6400	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu' 1020	96,6933	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1021	83,9171	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu' 1022	82,8471	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1

DiPiù 1023	81,3971	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1024	83,3142	BOND	Credit Suisse (USA) Inc	AA-	Aa1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1025	84,4600	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 1026	83,7571	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1027	71,7847	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1028	84,1171	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1029	76,5147	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 103	126,0100	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1030	95,2367	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1031	84,1271	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1032	87,2300	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 1033 Exclusive	86,0000	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 1034	101,4692	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1035	95,0999	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1036	89,8038	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1037	94,7528	BOND	Bank of America Corporation	AA	Aa2
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1038	81,5996	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 104	125,7600	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù 1040	93,8345	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1041	93,4212	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Deutsche Bank AG Frankfurt	AA-	Aa1
DiPiù 1042	84,9038	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 1043	92,6666	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 1044	83,2097	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1045	83,2797	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1046	85,1928	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 1047	91,4119	BOND	Bank of America Corporation	AA	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 1048	87,0647	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	JPMorgan Chase Bank	AA	Aaa
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1049	85,3138	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Fortis Bank S.A./N.V.	AA-	Aa3
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 105	122,4100	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù 1050	79,3019	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1051	91,7200	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1

DiPiù 1051 Bis	91,3800	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù 1051 Quater	90,6000	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù 1051 Tris	80,1915	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1052	85,9872	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	JPMorgan Chase Bank	AA	Aaa
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1053	95,9496	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1054	101,2500	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1055	98,0775	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1056	99,5588	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1057	99,1439	BOND	European Investment Bank	AAA	Aaa
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1058	78,0100	Titolo Strutturato	Banca Aletti & Co. S.p.A	A	
DiPiù 106	120,0800	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1060	93,0962	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1061	92,9500	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 1062	94,3020	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1063	98,3884	BOND	European Investment Bank	AAA	Aaa
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1064	83,9396	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 1065	88,0600	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	JPMorgan Chase Bank	AA	Aaa
DiPiù 1066	91,1666	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 1068	90,8466	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 107	115,3700	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù 1071	86,1321	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1072	88,5768	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1073	92,8451	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1074	88,2700	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	JPMorgan Chase Bank	AA	Aaa
DiPiù 1075	89,1775	BOND	European Investment Bank	AAA	Aaa
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1076	91,0458	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1078	81,8900	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	Banca d'Intermed.Mobiliare IMI SpA.	AA-	Aa3
DiPiù 1079	97,0524	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 108	111,0800	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 1081	85,8896	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 1083	97,5800	BOND	Italy, Republic of	A+	Aa2
		Opzione	Fortis Bank S.A./N.V.	AA-	Aa3
DiPiù 1084	89,2995	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù 1085	93,5161	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	

		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù 109	116,9350	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banca Monte dei Paschi di Siena	A	Aa3
DiPiù 110	107,8900	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù 111	112,0100	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 112	105,8200	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 113	112,6100	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 114	105,6200	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 115	114,9700	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 116	110,4800	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 118	112,1100	Opzione	Societe Generale	AA-	Aa2
		BOND	SNS Bank N.V.	A	
DiPiù 119	108,3300	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù 120	100,8800	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiù 121	100,4500	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 122	90,3400	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 2005	82,1700	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiù 2005-16	79,7671	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù 2005-17	64,2881	BOND	Lehman Brothers Holdings Inc.	A	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 2005-18	60,3822	BOND	Lehman Brothers Holdings Inc.	A	A1
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù 2005-3	81,0500	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiù 2005-4	68,2200	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Natixis Banque Populaires	AA-	Aa3
DiPiù 2005-5	70,5800	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Natixis Banque Populaires	AA-	Aa3
DiPiù 2005-6	81,7600	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiù 2005-7	80,5600	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Natixis Banque Populaires	AA-	Aa3
DiPiù 2005 Bis	67,8700	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiù 2005 Ter	68,8700	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiù 2006-7	84,2100	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 2006-8	77,4782	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	UBS Limited	AA-	
DiPiù 20 Per 50	82,8500	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiù 4 Markets	85,8200	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 4 Markets 2	69,3100	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Bank of America NA New York	AA+	Aaa
DiPiù 4 Markets Bis	80,8500	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 4 Markets Quater	69,9900	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiù 4 Markets Ter	82,7700	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiù 6 Years Basket	101,2300	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiù 6 Years Basket 10	93,9200	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1

DiPiù 6 Years Basket 11	93,8500	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 12	93,6300	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 13	93,2300	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 14	90,8000	Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		BOND	SNS Bank N.V.	A	
DiPiù 6 Years Basket 15	92,6100	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù 6 Years Basket 16	91,1300	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
DiPiù 6 Years Basket 17	90,8700	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 18	85,9900	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 19	90,0100	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù 6 Years Basket Bis	101,3900	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiù 6 Years Basket 20	85,5200	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 21	89,3000	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù 6 Years Basket 22	90,1266	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 23	89,9266	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 24	88,4458	BOND	Bank of America Corporation	AA	Aa2
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
		SWAP	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiù 6 Years Basket 25	88,7057	BOND	Bank of America Corporation	AA	Aa2
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù 6 Years Basket 26	86,6798	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù 6 Years Basket 27	80,2400	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù 6 Years Basket Ter	98,5098	Titolo Strutturato	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
DiPiù 6 Years Basket 4	97,8200	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiù 6 Years Basket 6	97,0300	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiù 6 Years Basket 7	95,2900	Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiù 6 Years Basket 8	93,7500	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù 6 Years Basket 9	94,3800	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 03 (27/02/1998)	152,7441	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (29/05/1998)	142,9530	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/08/1998)	142,9530	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/11/1998)	129,9490	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (26/02/1999)	136,8800	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/05/1999)	131,5900	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/08/1999)	130,6100	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/11/1999)	129,6100	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 03 (29/02/2000)	146,0405	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/05/2000)	137,5516	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/08/2000)	144,9640	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/11/2000)	140,9948	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (28/02/2001)	139,1399	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/05/2001)	135,1637	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/08/2001)	130,2649	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/11/2001)	126,1151	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (28/02/2002)	128,3190	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (31/05/2002)	127,8295	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/08/2002)	129,9300	Titolo Strutturato	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù PAC 03 (29/11/2002)	132,9341	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (28/02/2003)	130,6022	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/05/2003)	152,6100	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1

DiPiù PAC 03 (29/08/2003)	122,9777	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (28/11/2003)	115,1397	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (27/02/2004)	114,9403	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/05/2004)	119,0800	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/08/2004)	128,4343	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/11/2004)	108,2743	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (28/02/2005)	112,3843	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/05/2005)	108,1029	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/08/2005)	116,0331	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 03 (30/11/2005)	100,3536	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (28/02/2006)	101,9328	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/05/2006)	104,6158	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/08/2006)	100,9533	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (30/11/2006)	101,6970	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (28/02/2007)	101,8895	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/05/2007)	100,9294	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (31/08/2007)	100,1724	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 03 (30/11/2007)	98,2893	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (26/02/1999)	131,8300	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 04 (31/05/1999)	132,4400	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 04 (31/08/1999)	131,7400	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 04 (30/11/1999)	130,8100	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù PAC 04 (29/02/2000)	148,9971	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (31/05/2000)	142,1590	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (31/08/2000)	146,9989	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (30/11/2000)	143,0885	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (28/02/2001)	140,4616	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (31/05/2001)	136,5887	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (31/08/2001)	133,8011	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (30/11/2001)	127,4322	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (28/02/2002)	129,5229	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (31/05/2002)	128,9655	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (30/08/2002)	124,4900	Titolo Strutturato	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù PAC 04 (29/11/2002)	126,6908	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (28/02/2003)	122,7460	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (30/05/2003)	145,9935	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (29/08/2003)	117,7838	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (28/11/2003)	110,8798	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (27/02/2004)	109,5861	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/05/2004)	110,8861	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/08/2004)	120,6040	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (30/11/2004)	103,8373	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (28/02/2005)	106,6675	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/05/2005)	100,6222	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/08/2005)	107,7617	Titolo Strutturato	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù PAC 04 (30/11/2005)	99,4610	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (28/02/2006)	100,3900	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/05/2006)	98,6785	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/08/2006)	97,6029	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (30/11/2006)	98,0975	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (28/02/2007)	98,5320	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/05/2007)	97,6227	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (31/08/2007)	97,5560	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (30/11/2007)	93,6974	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (29/02/2008)	95,8173	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù PAC 04 (30/05/2008)	95,2473	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiù Big Chance 2004	92,7300	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Societe Generale	AA-	Aa2
DiPiù Chorus 1 America	91,3400	Titolo Strutturato	Mutual Fund Basket Investments Ltd	AA-	Aa1
DiPiù Chorus 1 Europa	91,3000	Titolo Strutturato	Mutual Fund Basket Investments Ltd	AA-	Aa1
DiPiù Chorus 1 Pacifico	91,4400	Titolo Strutturato	Mutual Fund Basket Investments Ltd	AA-	Aa1
DiPiù Chorus 2	90,8500	Titolo Strutturato	Mutual Fund Basket Investments Ltd	AA-	Aa1
DiPiù Chorus 3 Global	91,7500	Titolo Strutturato	Mutual Fund Basket Investments Ltd	AA-	Aa1
DiPiù Chance 1	98,4900	Titolo Strutturato	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù Chance 2	93,3800	Titolo Strutturato	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù Chance 3	98,3700	Titolo Strutturato	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù Changeover	90,6100	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Changeover 2	91,1100	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1

DiPiù Changeover 3	86,5100	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù Changeover 4	90,2700	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Centro Nord	90,4227	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Centro Nord 2	90,4209	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
Double Premium 1080	86,0000	Titolo Strutturato	Abn Amro Bank N.V., London branch	AA-	Aa2
DiPiù Ecology	78,2200	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	JPMorgan Chase Bank	AA	Aaa
DiPiù Evoluzione 2004-1	116,6200	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù Evoluzione 2004-2	96,7000	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù Exclusive Power 2006 - Dollaro	85,9600	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Exclusive Power 2006 - Euro	72,6800	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù Granducato	95,7025	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Granducato Bis	94,3607	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Granducato Quater	91,7551	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Granducato Ter	92,9858	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Key 1	97,2500	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiù Key 10-1	102,5680	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Key 10-2	101,8108	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Key 11-1	90,3224	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Key 11-2	90,1366	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Key 11-3	75,5000	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Credito Emiliano S.p.A.	A	
DiPiù Key 12	95,1310	BOND	European Investment Bank	AAA	Aaa
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù Key 14 Dollaro	88,4307	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiù Key 15	83,4000	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Fortis Bank S.A./N.V.	AA-	Aa3
DiPiù Key 15 Bis	83,6400	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiù Key 18D	96,2700	Titolo Strutturato	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiù Key 2	83,5800	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiù Key 20	93,0600	Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
		BOND	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù Key 21	94,2400	Opzione	JPMorgan Chase Bank	AA	Aaa
		BOND	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù Key 22 Dollaro	92,6860	Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		BOND	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiù Key 2 Bis	88,5335	BOND	J.P. Morgan Chase & Co.	AA-	Aa2
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Key 3	82,7700	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Key 4 Quater	101,3000	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiù Key 4 Quinquies	116,9305	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiù Key 4 Ter	104,4100	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Key 5 Quater	100,1200	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiù Key 5 Quinquies	116,6757	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3

		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Key 5 Ter	101,3100	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Key 8	75,9500	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Key 4	121,9300	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Key 4 Bis	107,4600	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Key 5	119,0700	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Key 5 Bis	104,1800	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Key Moment 6 Dollaro	85,8400	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Key Moment 6 Euro	73,1400	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Key Moment 7 Dollaro	77,6500	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Royal Bank of Scotland Plc	AA	Aa1
DiPiu Key Moment 7 Euro	73,9900	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	UBS Limited	AA-	Aa1
DiPiu Money 1	85,6328	Titolo Strutturato	Royal Bank of Scotland Plc	AA	Aa1
DiPiu Money 2	81,3584	Titolo Strutturato	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Money 3	77,5719	Titolo Strutturato	Jackson N.L.Funding, Llc		A3
DiPiu Money 19 Euro	93,1700	Titolo Strutturato	Fiat Finance & Trade Ltd		Baa3
DiPiu Money 2003-1	89,1200	BOND	Trees Sa		Aaa
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Money 2003-10	87,5400	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Money 2003-11	88,4500	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2003-12	88,0500	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2003-13	83,9300	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2003-14	78,4500	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2003-15	84,8900	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2003-2	89,6600	Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Money 2003-3	92,3590	BOND	BNP Paribas	AA+	Aa1
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Money 2003-4	87,0400	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Money 2003-5	81,4900	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Money 2003-6	88,3700	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Money 2003-7	89,3100	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2003-8	81,9600	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Money 2003-9	88,4500	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2004-1	85,0700	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2004-10	66,5000	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Money 2004-11	63,6300	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Money 2004-2	79,6700	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Money 2004-3	81,4300	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2004-4	77,9400	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Money 2004-5	73,0300	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2004-6	72,3700	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3

		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2004-7	72,8519	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2004-8	69,7100	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Money 2004-9	72,4878	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Money 2005	80,0700	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Societe Generale	AA-	Aa2
DiPiu Money 2005-1	65,9200	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Money 2005-3	80,4200	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Money 2005 Bis	65,4900	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Money 2006-4	83,8100	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Money 2006-5	83,2400	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Money 2006-6	86,5148	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	UBS Limited	AA-	
DiPiu Money 2006/7	84,7277	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Deutsche Bank AG Frankfurt	AA-	Aa1
DiPiu Money 2007/3	81,5243	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Money 2007/5	82,7850	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Credito Emiliano S.p.A.	A	
DiPiu Money 2007/6	85,4274	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Money 2007/7	87,1977	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Money 20 Dollaro	95,1262	Titolo Strutturato	Allmerica Global Funding Llc		Baa3
DiPiu Money 21 Euro	93,8400	Titolo Strutturato	Fiat Finance & Trade Ltd		Baa3
DiPiu Money 22 Dollaro	90,2605	Titolo Strutturato	Fiat Finance & Trade Ltd		Baa3
DiPiu Money 23 Dollaro	95,3724	Titolo Strutturato	Fiat Finance & Trade Ltd		Baa3
DiPiu Money 24 Euro	95,6800	Titolo Strutturato	Fiat Finance & Trade Ltd		Baa3
DiPiu Money 25 Euro	91,0800	Titolo Strutturato	Westfaelische Hypothekenbank Ag	NR	A2
DiPiu Money 26 Dollaro	96,5244	Titolo Strutturato	Bear Stearns Global Asset Holdg Ltd	AA-	Aa2
DiPiu Money 27 Euro	98,6081	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 28 Euro	97,6879	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 29 Euro	97,3587	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 30 Dollaro	98,9551	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 31 Euro	94,2250	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 32 Euro	95,9107	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 33 Dollaro	97,9473	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 34 Euro	90,0498	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 35 Dollaro	92,0026	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 36 Euro	144,6400	Titolo Strutturato	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
DiPiu Money 37 Euro	90,3202	Titolo Strutturato	SNS Reall Groep N.V.	A-	A3
DiPiu Money 38 Dollaro	93,2956	Titolo Strutturato	SNS Reall Groep N.V.	A-	A3
DiPiu Money 39 Euro	89,9808	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 40 Dollaro	93,8775	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Money 41 Euro	94,7900	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 42 Dollaro	95,2522	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Money 43 Euro	93,4440	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Money 44 Dollaro	96,6892	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Money 45 Euro	103,0104	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Money 46 Dollaro	104,4660	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Money 47 Euro	101,9862	Titolo Strutturato	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Money 48 Dollaro	100,1868	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 49 Euro	101,8050	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 50 Euro	101,0025	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 51 Dollaro	101,0733	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 52 Euro	99,9467	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 53 Euro	93,2539	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 54 Dollaro	102,9200	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 55 Euro	96,7296	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1

DiPiu Money 56 Dollaro	100,0338	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 57 Euro	96,7296	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 58 Euro	96,7296	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 59 Dollaro	100,3250	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 60 Euro	94,4200	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 61 Dollaro	93,1889	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 62 Euro	93,4000	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 63 Dollaro	98,5678	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 64 Dollaro	97,7760	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 65 Euro	92,6400	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 66 Dollaro	97,3885	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Money 67 Euro	93,5800	Titolo Strutturato	Banco Popolare Soc Cooperativa	A	A2
DiPiu Money 68 Dollaro	98,2300	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Money 69 Euro	95,2200	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Money 70 Dollaro	94,5669	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Money 71 Euro	95,8400	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Money 72 Dollaro	98,6650	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Money 73 Euro	98,0508	Titolo Strutturato	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
DiPiu Money 74 Dollaro	93,3900	Titolo Strutturato	Banco Popolare Soc Cooperativa	A	A2
DiPiu Money 75 Euro	95,2100	Titolo Strutturato	Natixis Banque Populaires	AA-	Aa3
DiPiu Money 76 Dollaro	106,0300	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Money 77 Euro	100,2838	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Money 78 Euro	102,4986	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Money 79 Dollaro	104,5040	Titolo Strutturato	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
DiPiu Money 80 Euro	98,4082	Titolo Strutturato	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
DiPiu Money 80 Euro - 2004	96,6681	Opzione	Bearn Stearns Bank plc	AA-	Aa2
DiPiu Money 81 Euro	100,3615	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Money 82 Euro	100,4137	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Money 83 Euro	99,3064	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Money Gold 2	100,7875	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money 2003	89,1200	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Money Platinum Euro	96,9180	Titolo Strutturato	Caisse C'ale Credit Immobilier Fr	A+	A1
DiPiu Money Gold	97,2591	Titolo Strutturato	SNS Reall Groep N.V.	A-	A3
DiPiu New World	167,7900	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Espanol de Credito, S.A.	AA	Aa2
DiPiu New World 6	71,6100	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu New World 7	76,2800	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Platinum 2005	72,6300	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Platinum 6 Years Basket 12	88,4458	BOND	Bank of America Corporation	AA	Aa2
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
		SWAP	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiu Platinum Big Chance 2004	92,7400	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2004-10	74,5419	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2004-11	73,6700	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Platinum Money 2004-12	74,9156	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Platinum Money 2004-13	69,9200	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2004-14	68,2500	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2004-15	66,2400	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Platinum Money 2004-16	68,1300	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2004-17	81,5445	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-10	86,1068	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Platinum Money 2006-11	86,5548	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1

		SWAP	Deutsche Bank AG Frankfurt	AA-	Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-12	82,2855	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Deutsche Bank AG Frankfurt	AA-	Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-13	86,5032	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Platinum Money 2006-14	68,1200	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2007-11	68,4364	BOND	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2007-12	84,8728	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Platinum Money 2007-13	91,1300	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Platinum Money 2007-14	89,4958	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Platinum Money 2007-15	88,2933	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Platinum Power 2006 - Dollaro	83,0600	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	Aa1
DiPiu Platinum Power 2006 - E	71,9400	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Platinum 2005 - 2	71,0700	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum 2005 - 3	87,4142	BOND	Aegon N.V.	A+	A2
		Opzione	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
		SWAP	UBS Limited	AA-	
DiPiu Platinum 2005 - 5	61,6744	BOND	Lehman Brothers Holdings Inc.	A	A1
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Platinum 2006 - 10	84,8800	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Platinum 2006 - 4 Bis	65,6447	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum 2006 - 8	85,4500	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum 2006 - 9	73,2372	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Fortis Bank S.A./N.V.	AA-	Aa3
		SWAP	UBS Limited	AA-	
DiPiu Platinum 100	140,2953	Opzione	Bear Stearns International Limited	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Platinum 101	129,9500	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Platinum 102	131,0600	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Platinum 103	126,5200	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 104	114,2600	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 105	125,5900	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banca Monte dei Paschi di Siena	A	Aa3
DiPiu Platinum 106	117,8300	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 107	119,1200	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 108	118,7600	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 109	110,5900	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Platinum 110	119,8100	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Platinum 111	118,7500	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Platinum 112	111,5200	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Platinum 113	102,2800	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Platinum 114	93,9100	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Platinum 6 Years Basket 10	94,2100	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2

		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum 6 Years Basket 11	89,9266	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum 6 Years Basket 13	88,8757	BOND	Bank of America Corporation	AA	Aa2
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Platinum 6 Years Basket 14	86,6798	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
DiPiu Platinum 6 Years Basket 15	80,2300	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum 6 Years Basket Bis	102,3400	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum 6 Years Basket Ter	99,4737	Titolo Strutturato	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
DiPiu Platinum 6 Years Basket 4	97,8900	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Platinum 6 Years Basket 5	94,0500	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 6 Years Basket 6	93,9100	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 6 Years Basket 7	95,2200	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 6 Years Basket 8	94,6400	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum 6 Years Basket 9	95,2900	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum 6 Years Basket	102,2298	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum 96	126,4400	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum 97	121,3211	Titolo Strutturato	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
DiPiu Platinum 98	137,6700	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Platinum 99	138,1300	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Platinum Money 2003-1	92,9500	Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Platinum Money 2003-2	84,7200	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2003-3	79,0430	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum Money 2003-4	83,1200	Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		BOND	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Platinum Money 2003-5	85,9200	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2003-6	85,8000	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2003-7	85,8900	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2003-8	82,4100	Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		BOND	SNS Bank N.V.	A	
DiPiu Platinum Money 2004-1	82,4800	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Platinum Money 2004-2	82,8800	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2004-3	79,8900	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Platinum Money 2004-4	73,0400	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Platinum Money 2004-5	73,2700	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2004-6	81,0900	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2004-7	75,1019	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2004-8	74,2419	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2004-9	75,1219	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Platinum Money 2005	81,4900	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1

DiPiu Platinum Money 2005-1	67,7300	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2005-2	81,0400	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-4	85,4300	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-5	75,6094	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-6	84,3900	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-7	84,7100	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2006-8	76,0571	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Platinum Money 2006-9	81,3935	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Platinum Money 2007-6	58,0075	BOND	Banca Italease SpA		Ba1
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 2007-7	82,9443	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Platinum Money 10	100,2989	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money 11	102,9512	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money 12	103,6905	Titolo Strutturato	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
DiPiu Platinum Money 13	98,9602	Titolo Strutturato	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
DiPiu Platinum Money 13 - 2004	97,2147	Opzione	Bearn Stearns Bank plc	AA-	Aa2
DiPiu Platinum Money 14	101,0063	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money 15	105,1800	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money 2003	89,5300	Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		BOND	Trees Sa		Aaa
DiPiu Platinum Money 2 Euro	94,8720	Titolo Strutturato	Banco Popolare Soc Cooperativa	A	A2
DiPiu Platinum Money 3	93,1725	Titolo Strutturato	Banco Popolare Soc Cooperativa	A	A2
DiPiu Platinum Money 4	92,4571	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money 5	93,2563	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money 6	95,7294	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Platinum Money 7	96,6389	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money 8	95,4125	Titolo Strutturato	Erste Bank der Oest. Sparkassen Ag	A	Aa3
DiPiu Platinum Money 9	100,6450	Titolo Strutturato	Mediobanca S.p.A.	AA-	
DiPiu Platinum Money Dollaro	92,9221	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Platinum New World	178,3100	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Espanol de Credito, S.A.	AA	Aa2
DiPiu Platinum Special	93,0600	Opzione	JPMorgan Chase Bank	AA	Aaa
		BOND	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Platinum Money 2007-10	80,8700	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Credito Emiliano S.p.A.	A	
DiPiu Platinum Power 2006 - Dollaro 3	75,2100	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Power 2006 - Dollaro	74,3200	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Power 2	124,3400	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Power 2 Bis	111,7100	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Power 4	110,4300	BOND	Eirles Four Ltd	AAA	
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Power 6	108,3400	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Power 7	114,1400	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Power 8	117,2400	BOND	Bear Stearns Companies Incorporated	AA-	Aa2
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiu Shot	78,9200	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Sprint 2005-5	95,8680	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Sprint 2006-10	88,4500	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1

		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Sprint 2006-11	88,6596	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bearn Stearns Bank plc	AA-	Aa2
DiPiu Sprint 2008/3	90,4227	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Sprint 2008/3 Bis	90,4209	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Sprint 2005	96,9900	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	NIBC Bank N.V.	BBB+	Baa1
DiPiu Sprint 2005-2	97,3200	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Barclays Bank PLC	AA	Aa1
DiPiu Sprint 2006-7	92,2500	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiu Sprint 2006-8	93,8100	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Dresdner Bank AG	A	Aa2
DiPiu Sprint 2006-9	93,0900	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Sprint 2008	92,5200	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Sprint 2008-1	92,3800	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Sprint 2008-2	90,9575	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Sprint 2008-4	91,9117	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Sprint 2008-5	90,7200	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Sprint 2008-6	91,7400	Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		BOND	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Sprint 2008-7	92,3100	Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
		BOND	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Sprint 7% Bis	89,7400	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	AA	Aa1
DiPiu Sprint 7% Dic 07	93,8811	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Sprint 7% Quater	94,9784	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
DiPiu Sprint 7% Quinquies	93,7100	BOND	Mediobanca S.p.A.	AA-	
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Sprint 7% Ter	90,0700	Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
		BOND	Unicredit S.p.A.	A+	Aa2
DiPiu Sprint Exclusive 10	96,8600	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Sprint Exclusive 11	95,9700	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Sprint Exclusive 5	99,2074	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		SWAP	BNP Paribas	AA+	Aa1
DiPiu Sprint Exclusive 6	99,0700	BOND	Citigroup Global Markets Hold. Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Sprint Exclusive 7	98,8100	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Sprint Exclusive 8	98,4000	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Sprint Exclusive 9	97,8700	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	BancoSantander Central Hispano S.A.	AA	Aa1
DiPiu Step 2006-1	74,4692	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiu Step 2007-10	79,5300	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiu Step 2007-5	64,4502	BOND	Banca Italease SpA		Ba1
		Opzione	ING Bank NV	AA	Aa1
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Step 2007-8	60,9082	BOND	Lehman Brothers Treasury Co Bv	A	A1
		SWAP	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiu Step 2007-9	71,7900	BOND	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
		Opzione	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
DiPiu Step 10 Standard	96,6270	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1

		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 10 Platinum	99,1740	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 10 Exclusive	101,7210	BOND	Goldman Sachs Group Inc.	AA-	Aa3
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 2006	81,1700	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Deutsche Bank AG Frankfurt	AA-	Aa1
DiPiù Step 5 Standard	104,0733	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 5 Platinum	106,7523	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 5 Exclusive	109,4313	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 6 Standard	92,2219	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 6 Platinum	95,1389	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 6 Exclusive	98,0559	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 7 Standard	102,4998	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 7 Platinum	105,1398	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 7 Exclusive	107,7798	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
DiPiù Step 8 Standard	91,5989	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
		SWAP	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù Step 8 Platinum	94,6049	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
		SWAP	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù Step 8 Exclusive	97,6109	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Credit Suisse International	AA-	Aa1
		SWAP	Credit Suisse International	AA-	Aa1
DiPiù Step 9 Standard	94,0240	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù Step 9 Platinum	96,4680	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù Step 9 Exclusive	98,9120	BOND	Merrill Lynch & Co., Inc.	A	A1
		Opzione	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
DiPiù Step Platinum 2006	82,1100	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Bayerische Hypo- Milan branch	A+	A1
		SWAP	Deutsche Bank AG Frankfurt	AA-	Aa1
DiPiù Step Platinum 2006 - 1	76,0926	BOND	Morgan Stanley	A+	A1
		Opzione	Calyon-Credit Agricole's Corp&Inv.	AA-	Aa1
		SWAP	Intesa San Paolo S.p.A	AA-	Aa2
DiPiù Summer 2	102,7834	Titolo Strutturato	Banca Agrileasing S.p.A.	A	A3
Tris 1059	91,4000	Titolo Strutturato	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
World Express 1069	93,9900	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
World Express 1070	98,0700	Titolo Strutturato	Deutsche Bank AG, London Brch		Aa1
World Express 1070B	94,7600	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
World Express 1077	97,3900	Titolo Strutturato	Abn Amro Bank N.V., London branch	AA-	Aa2
World Express 1082	92,3300	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1
World Express 1086 Dollaro	97,8800	Titolo Strutturato	Bayerische Hypo- und Vereinsbank Ag	A+	A1