

Spettabile
Borsa Italiana S.p.A.
 Piazza Degli Affari 6
 20123 Milano

Milano, 30/12/2015

OGGETTO: RETTIFICA DI COVERED WARRANT E CERTIFICATES EMESSI DA BANCA IMI S.P.A. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

- **Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:** Spin-off di Fiat Chrysler Automobiles a favore di Ferrari N.V., mediante assegnazione, agli azionisti di Fiat Chrysler Automobiles ("FCA"), di azioni ordinarie Ferrari N.V. ("RACE") in ragione di n.1 azione ordinaria RACE per ogni n.10 azioni ordinarie FCA possedute, e rimborso, agli azionisti ordinari di FCA, del valore nominale di 0.01 Euro delle azioni ordinarie FE Interim B.V. ritirate e annullate, che sono state precedentemente assegnate agli azionisti ordinari FCA nel rapporto di n.1 azione ordinaria FE Interim B.V. per ogni n.1 FCA ordinaria posseduta (vedi avviso di Borsa Italiana n.21127 del 15 dicembre 2015). Quanto precede - unitamente all'avvio della quotazione delle azioni RACE - avrà data di efficacia a partire dal 4 gennaio 2016, **subordinatamente alla conclusione dell'iter autorizzativo e al perfezionamento dell'operazione che saranno oggetto di conferma da Borsa Italiana mediante apposito Avviso entro le 7:59 di lunedì 4 gennaio 2016 (vedi avviso di Borsa Italiana n.21127 del 15 dicembre 2015).**
- **Data di efficacia subordinata:** 04/01/2016
- **Codice ISIN dell'azione ordinaria FCA:** NL0010877643
- **Codice ISIN dell'azione ordinaria RACE:** NL0011585146
- **Mercato dei derivati di riferimento:** Idem – Borsa Italiana
- **Modalità di Rettifica:** 1) A fronte del rimborso del valore nominale delle azioni FE Interim B.V. di Euro 0.01, applicazione a Strike e Multiplo del coefficiente $K=0.999226$, calcolato e pubblicato da Idem sulla base del prezzo di chiusura delle azioni ordinarie FCA rilevato il 30 dicembre 2015 (come da avviso di Borsa Italiana n.21128 del 15 dicembre 2015); e 2) Sostituzione del Vecchio Sottostante FCA già rettificato come da punto 1) con un Nuovo Sottostante costituito da un paniere composto da n.1 azione FCA ex assegnazione/rimborso e da n.0.1 azioni RACE (come da avvisi di Idem n.21128 e di Borsa Italiana n.21127 del 15 dicembre 2015).
- **Caratteristiche del certificate ante e post rettifica in forma tabellare:**

ISIN	Vecchio Sottostante	Vecchio Strike	Vecchio Multiplo	Vecchia Barriera	Nuovo Sottostante	ISIN Fiat Chrysler	ISIN Ferrari NV	Nuovo Strike	Nuovo Multiplo	Nuova Barriera
XS1322970291	Fiat Chrysler	13.02	76.80492	10.4160	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	13.0099	76.86441	10.4079

- **Caratteristiche dei covered warrant ante e post rettifica in forma tabellare:**

ISIN	Tipo	C/P	Vecchio Sottostante	Vecchio Strike	Vecchio Multiplo	Nuovo Sottostante	ISIN Fiat Chrysler	ISIN Ferrari NV	Nuovo Strike	Nuovo Multiplo
IT0005116113	CW	Call	Fiat Chrysler	16	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	15.9876	0.100077
IT0005116121	CW	Call	Fiat Chrysler	17	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	16.9868	0.100077
IT0005116139	CW	Call	Fiat Chrysler	17	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	16.9868	0.100077
IT0005116147	CW	Call	Fiat Chrysler	18	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	17.9860	0.100077
IT0005141178	CW	Call	Fiat Chrysler	16	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	15.9876	0.100077
IT0005141186	CW	Call	Fiat Chrysler	16.5	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	16.4872	0.100077
IT0005141194	CW	Call	Fiat Chrysler	17	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	16.9868	0.100077
IT0005141202	CW	Call	Fiat Chrysler	19	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	18.9852	0.100077
IT0005141210	CW	Call	Fiat Chrysler	16	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	15.9876	0.100077
IT0005141228	CW	Call	Fiat Chrysler	18	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	17.9860	0.100077
IT0005141236	CW	Call	Fiat Chrysler	20	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	19.9845	0.100077
IT0005153140	CW	Call	Fiat Chrysler	14	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	13.9891	0.100077
IT0005153157	CW	Call	Fiat Chrysler	14	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	13.9891	0.100077
IT0005153165	CW	Call	Fiat Chrysler	15	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	14.9883	0.100077
IT0005153173	CW	Call	Fiat Chrysler	14	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	13.9891	0.100077
IT0005153181	CW	Call	Fiat Chrysler	15	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	14.9883	0.100077
IT0005153199	CW	Call	Fiat Chrysler	16	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	15.9876	0.100077
IT0005153207	CW	Call	Fiat Chrysler	15	0.1	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	14.9883	0.100077

- **DATA DI EFFICACIA SUBORDINATA DELLA RETTIFICA:** 04/01/2016

Distinti saluti
Banca IMI S.p.A.