

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

Milano, 29/04/2016

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:** Assegnazione di azioni RCS MEDIAGROUP SpA ("RCS") agli azionisti di Fiat Chrysler Automobiles N.V. ("FCA") in ragione di n. 0.067746 azioni RCS (prive di valore nominale - ISIN: IT0004931496) ogni n. 1 azione ordinaria FCA (del valore nominale di Euro 0.01 - ISIN: NL0010877643) posseduta. Tale operazione avrà luogo previa una scissione nel cui ambito FCA trasferirà la partecipazione detenuta in RCS a Interim One B.V. (secondo il rapporto di n. 1 azione Interim One B.V. ogni n. 1 azione FCA posseduta) e successiva liquidazione di Interim One B.V. con conseguentemente assegnazione di azioni RCS agli azionisti FCA nel rapporto indicato (vedi avviso di Borsa Italiana n. 7282 del 18 aprile 2016). Quanto precede avrà data di efficacia a partire dal 2 maggio 2016, **subordinatamente al perfezionamento dell'operazione che sarà oggetto di conferma da parte di Borsa Italiana mediante apposito Avviso entro le 7:59 di lunedì 2 maggio 2016 (vedi avviso di Borsa Italiana n. 7282 del 18 aprile 2016).**
- **Data di efficacia:** 02/05/2016
- **Codice ISIN dell'azione ordinaria FCA:** NL0010877643
- **Codice ISIN dell'azione ordinaria RCS:** IT0004931496
- **Mercato dei derivati di riferimento:** Idem - Borsa Italiana
- **Modalità di Rettifica:** Applicazione a Strike e Multipli del sottostante FCA del coefficiente $K = 0.994559$ calcolato secondo la formula riportata nell'Avviso di Borsa Italiana n. 7433 del 20 aprile 2016 e arrotondato alla sesta cifra decimale (vedi Avviso di Idem Borsa Italiana n. 7458 del 20 aprile 2016). Nel caso di prodotti aventi per sottostante il basket di azioni FCA e Ferrari N.V. ("RACE"), a Strike e Multipli verrà applicato un fattore di rettifica, $K_{bis} = 0.996514$, calcolato ad hoc utilizzando quale prezzo *cum* il valore del basket di azioni FCA e RACE nel giorno di Borsa antecedente l'avvio dell'operazione (29 aprile 2016) - come da Avviso di Idem Borsa Italiana n. 7458 del 20 aprile 2016.
- **Caratteristiche dei certificate ante e post rettifica in forma tabellare:**

ISIN	Sottostante	ISIN Sottostante	Vecchio Strike	Vecchio Multiplo	Vecchia Barriera	Vecchio Livello Protezione	Nuovo Strike	Nuovo Multiplo	Nuova Barriera	Nuovo Livello Protezione
XS1379148676	Fiat Chrysler Automobiles S.A.	NL0010877643	6.1050	163.8002	6.1050	5.1893	6.0718	164.6963	6.0718	5.1610

ISIN	Sottostante	ISIN Fiat Chrysler	ISIN Ferrari NV	Vecchio Strike	Vecchio Multiplo	Vecchia Barriera	Nuovo Strike	Nuovo Multiplo	Nuova Barriera
XS1322970291	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	13.0099	76.86441	10.4079	12.9646	77.13330	10.3717

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

ISIN	C/P	Sottostante	ISIN Sottostante	Vecchio Strike	Vecchio Multiplo	Nuovo Strike	Nuovo Multiplo
IT0005173080	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	7.6	0.1	7.5586	0.100547
IT0005173098	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	7.8	0.1	7.7575	0.100547
IT0005173106	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	7.4	0.1	7.3597	0.100547
IT0005173114	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	8.5	0.1	8.4537	0.100547
IT0005173122	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	7.5	0.1	7.4591	0.100547
IT0005173130	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	8	0.1	7.9564	0.100547
IT0005173148	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	9.5	0.1	9.4483	0.100547
IT0005173155	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	8	0.1	7.9564	0.100547
IT0005173163	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	9	0.1	8.9510	0.100547
IT0005173171	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	10	0.1	9.9455	0.100547
IT0005173189	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	8	0.1	7.9564	0.100547
IT0005173197	Call	Fiat Chrysler	NL0010877643	9	0.1	8.9510	0.100547

ISIN	C/P	Sottostante	ISIN Fiat Chrysler	ISIN Ferrari NV	Vecchio Strike	Vecchio Multiplo	Nuovo Strike	Nuovo Multiplo
IT0005116139	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	16.9868	0.100077	16.9275	0.100427
IT0005116147	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	17.986	0.100077	17.9233	0.100427
IT0005141178	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	15.9876	0.100077	15.9318	0.100427
IT0005141186	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	16.4872	0.100077	16.4297	0.100427
IT0005141194	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	16.9868	0.100077	16.9275	0.100427
IT0005141202	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	18.9852	0.100077	18.9190	0.100427
IT0005141210	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	15.9876	0.100077	15.9318	0.100427
IT0005141228	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	17.986	0.100077	17.9233	0.100427

Banca IMI S.p.A. Sede Legale Largo Mattioli, 3 20121 Milano Capitale Sociale Euro 962.464.000,00 Registro Imprese di Milano, Codice Fiscale e Partita IVA 04377700150 N. Iscr. Albo delle Banche al n. 5570 Codice ABI 3249.0 Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei Depositi Società soggetta all'attività di Direzione e Coordinamento del socio unico Intesa Sanpaolo S.p.A. ed appartenente al gruppo bancario "Intesa Sanpaolo".

IT0005141236	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	19.9845	0.100077	19.9148	0.100427
IT0005153157	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	13.9891	0.100077	13.9403	0.100427
IT0005153165	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	14.9883	0.100077	14.9360	0.100427
IT0005153173	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	13.9891	0.100077	13.9403	0.100427
IT0005153181	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	14.9883	0.100077	14.9360	0.100427
IT0005153199	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	15.9876	0.100077	15.9318	0.100427
IT0005153207	Call	N. 1 Fiat Chrysler + N. 0.1 Ferrari NV	NL0010877643	NL0011585146	14.9883	0.100077	14.9360	0.100427

- **DATA DI EFFICACIA DELLA RETTIFICA: 02/05/2016**

Distinti saluti
Banca IMI S.p.A.