

Avviso ai Portatori di

BANCA IMI S.p.A. EQUITY PROTECTION CAP CERTIFICATES QUANTO SU PANIERE DI AZIONI PROTEZIONE 92% - 27.02.2020

Codice ISIN IT0005083107

relativo al Programma Equity Protection Certificates

OGGETTO: RETTIFICA A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA: Distribuzione di un dividendo straordinario di GBp 20 ogni N.1 azione GlaxoSmithKline PLC (GSK), ex date 18/02/2016.

Data di stacco: 18/02/2016

Codice ISIN dell'azione sottostante: GB0009252882

Mercato dei derivati di riferimento: ICE Futures Europe

Coefficiente di Rettifica: 0.985955 calcolato secondo le modalità rese note da ICE Futures Europe per la rettifica delle opzioni su GlaxoSmithKline PLC.

Vecchio Valore di Riferimento dell'Elemento Costitutivo del Paniere GlaxoSmithKline PLC ante rettifica*: 1548.30 GBp

Nuovo Valore di Riferimento dell'Elemento Costitutivo del Paniere GlaxoSmithKline PLC post rettifica*: 1526.5541 GBp

* Pari alla media aritmetica dei valori di riferimento di ciascun Elemento Costitutivo del Paniere rilevato nelle Date di Determinazione.

DATA DI EFFICACIA DELLA RETTIFICA: 18/02/2016

Distinti saluti Banca IMI S.p.A.

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".