

OBJECT: ADJUSTMENTS ON FIAT CHRYSLER UNDERLYING**GENERAL INFORMATION ABOUT THE CORPORATE ACTION****DESCRIPTION**

Assegnazione di azioni GEDI Gruppo Editoriale SpA ("GEDI") agli azionisti di Fiat Chrysler Automobiles N.V. ("FCA") in ragione di n. 0.0484 azioni ordinarie GEDI (valore nominale Euro 0.15 - ISIN: IT0001398541) ogni n. 1 azione ordinaria FCA (del valore nominale di Euro 0.01 – ISIN: NL0010877643) posseduta. Quanto precede avrà data di efficacia a partire dal 3 luglio 2017, 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 luglio 2017 (vedi avviso di Borsa Italiana n. 13249 del 29 giugno 2017).

Underlying ISIN Code

NL0010877643

Underlying Name

FIAT CHRYSLER

EFFECTIVE DATE

03/07/2017

DETAILS ABOUT THE ADJUSTMENT**ADJUSTMENT CRITERIA**

Applicazione a Strike e Multipli del sottostante FCA del coefficiente $K = 0.995855$ calcolato ad hoc secondo la formula riportata nell'Avviso di Borsa Italiana n. 13257 del 29 giugno 2017 ed applicato secondo quanto previsto dall'Avviso di Idem Borsa Italiana n. 13262 del 29 giugno 2017. Quanto precede avrà data di efficacia a partire dal 3 luglio 2017, 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 luglio 2017 (vedi avviso di Borsa Italiana n. 13249 del 29 giugno 2017).

DERIVATIVE MARKET

IDEM

ADJUSTMENT FACTOR

0.995855

FEATURES OF ADJUSTED FINANCIAL INSTRUMENTS

ADJUSTMENT EFFECTIVE DATE 03/07/2017

PLAIN VANILLA SINGLE SHARE

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	Strike Old	Strike
IT0005213696	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	8	7.96684
IT0005224180	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	10	9.95855
IT0005224198	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	10	9.95855
IT0005242612	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	12.5	12.448188
IT0005242620	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	13	12.946115
IT0005242638	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	14	13.94197

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	Strike Old	Strike
IT0005242646	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	14	13.94197
IT0005249286	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	11.5	11.452333
IT0005249294	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	14	13.94197
IT0005255267	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	11	10.954405
IT0005255275	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	12	11.95026
IT0005255283	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	12.5	12.448188
IT0005255291	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	13	12.946115
IT0005255309	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	13	12.946115
IT0005255317	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	13.5	13.444043
IT0005255325	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	13.5	13.444043
IT0005255333	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	12	11.95026
IT0005255341	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	14	13.94197
IT0005255358	FIAT CHRYSLER	0.1	0.100416225253677	16	15.93368

INVESTMENT CERTIFICATES SINGLE SHARE

Cod Isin	Underlying	Parity Old	Parity	First Barrier Old	First Barrier	CAP Old	CAP	Initial Value Old	Initial Value	Second Barrier Old	Second Barrier
IT0005244329	FIAT CHRYSLER	9.541985	9.5817011512 7202	7.336	7.305592			10.48	10.43656	7.336	7.305592
IT0005245961	FIAT CHRYSLER	9.689922	9.7302539024 2555	7.74	7.707918	11.4242	11.376847	10.32	10.277224		
IT0005257404	FIAT CHRYSLER	10.18849	10.230897068 3483	6.8705	6.842022			9.815	9.774317		
XS137914867 6	FIAT CHRYSLER	164.6963	165.38180759 2471	5.161	5.139608			6.0718	6.046632	6.0718	6.046632
XS151861199 8	FIAT CHRYSLER	140.1542	140.73755717 4488	4.9945	4.973798			7.135	7.105425		
XS152306652 7	FIAT CHRYSLER	141.9446	142.53540927 143	5.636	5.612639			7.045	7.015798		