

**Avviso ai Portatori di Covered Warrant
Banca IMI S.p.A. quotati al SeDeX**

**“BANCA IMI S.P.A. COVERED WARRANT su Azioni di tipo Call
Scadenza 05.12.2016, 06.03.2017, 05.06.2017 e 04.09.2017”**

e

**“BANCA IMI S.P.A. COVERED WARRANT su Azioni di tipo Call
Scadenza 06.03.2017, 05.06.2017, 04.09.2017 e 04.12.2017”**

e

**“BANCA IMI S.P.A. COVERED WARRANT su Azioni di tipo Call
Scadenza 05.06.2017, 04.09.2017, 04.12.2017 e 05.03.2018”**

e

**“BANCA IMI S.P.A. COVERED WARRANT su Azioni di tipo Call
Scadenza 05.06.2017, 04.09.2017, 04.12.2017, 05.03.2018 e
04.06.2018”**

e

**“BANCA IMI S.P.A. COVERED WARRANT su Azioni di tipo Call
Scadenza 04.09.2017, 04.12.2017, 05.03.2018, 04.06.2018 e
03.12.2018”**

Di seguito si comunica l'Importo di Liquidazione per i Covered Warrant in oggetto, relativamente alla scadenza del 4 settembre 2017.

Milano, 4 settembre 2017

Covered Warrant su Azioni scadenza 4 settembre 2017

| Codice ISIN | Attività Sottostante | Call/ Put | Strike Price | Data di Emissione | Data di Scadenza | Multiplo | Stile | Valore di Riferimento Finale | Importo di Liquidazione (EUR) |
|--------------|------------------------|--------------|-----------------|----------------------|---------------------|----------|---------|------------------------------------|-------------------------------------|
| IT0005223711 | Allianz | Call | 190 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 180,95 | 0 |
| IT0005249013 | Allianz | Call | 210 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 180,95 | 0 |
| IT0005254757 | Allianz | Call | 200 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 180,95 | 0 |
| IT0005213779 | Assicurazioni Generali | Call | 16 | 30/08/2016 | 04/09/2017 | 0,100416 | Europeo | 15,11 | 0 |
| IT0005224222 | Assicurazioni Generali | Call | 17 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 15,11 | 0 |
| IT0005223760 | Atlantia | Call | 28 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 27,02 | 0 |
| IT0005242356 | Atlantia | Call | 26 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 27,02 | 0,102 |
| IT0005249047 | Atlantia | Call | 29 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 27,02 | 0 |
| IT0005223802 | Banca Mediolanum | Call | 8 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 7,175 | 0 |
| IT0005242414 | Banca Mediolanum | Call | 9 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 7,175 | 0 |
| IT0005249062 | Banca Mediolanum | Call | 8,5 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 7,175 | 0 |
| IT0005223869 | Banco BPM | Call | 2,5544 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,015659 | Europeo | 3,23 | 0,01058 |
| IT0005223877 | Banco BPM | Call | 2,6821 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,015659 | Europeo | 3,23 | 0,00858 |
| IT0005223927 | Banco BPM | Call | 2,5 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,23 | 0,073 |
| IT0005223935 | Banco BPM | Call | 2,7 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,23 | 0,053 |
| IT0005249088 | Banco BPM | Call | 3 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,23 | 0,023 |
| IT0005249096 | Banco BPM | Call | 3,2 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,23 | 0,003 |
| IT0005249104 | Banco BPM | Call | 3,5 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,23 | 0 |
| IT0005254856 | Banco BPM | Call | 3,1 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,23 | 0,013 |
| IT0005254864 | Banco BPM | Call | 3,3 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,23 | 0 |
| IT0005242463 | BMW | Call | 100 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 79 | 0 |
| IT0005254930 | BMW | Call | 105 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 79 | 0 |
| IT0005249120 | BNP Paribas | Call | 70 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 64,35 | 0 |
| IT0005249138 | BNP Paribas | Call | 72 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 64,35 | 0 |
| IT0005254955 | BNP Paribas | Call | 75 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 64,35 | 0 |

| Codice ISIN | Attività Sottostante | Call/ Put | Strike Price | Data di Emissione | Data di Scadenza | Multiplo | Stile | Valore di Riferimento Finale | Importo di Liquidazione (EUR) |
|--------------|----------------------|--------------|-----------------|----------------------|---------------------|----------|---------|------------------------------------|-------------------------------------|
| IT0005242497 | Deutsche Bank | Call | 21,4201 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,112043 | Europeo | 13,535 | 0 |
| IT0005254989 | Deutsche Bank | Call | 20 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 13,535 | 0 |
| IT0005224040 | Enel | Call | 5 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 5,14 | 0,014 |
| IT0005242513 | Enel | Call | 4,8 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 5,14 | 0,034 |
| IT0005249153 | Enel | Call | 5,2 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 5,14 | 0 |
| IT0005249161 | Enel | Call | 5,5 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 5,14 | 0 |
| IT0005255028 | Enel | Call | 5,4 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 5,14 | 0 |
| IT0005255036 | Enel | Call | 5,6 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 5,14 | 0 |
| IT0005213621 | Eni | Call | 18 | 30/08/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 13,31 | 0 |
| IT0005242539 | Eni | Call | 19 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 13,31 | 0 |
| IT0005255135 | Eni | Call | 16,5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 13,31 | 0 |
| IT0005255143 | Eni | Call | 17 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 13,31 | 0 |
| IT0005255150 | Eni | Call | 17,5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 13,31 | 0 |
| IT0005224156 | Ferrari | Call | 70 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 97,25 | 2,725 |
| IT0005249252 | Ferrari | Call | 85 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 97,25 | 1,225 |
| IT0005255234 | Ferrari | Call | 90 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 97,25 | 0,725 |
| IT0005213696 | Fiat Chrysler Aut. | Call | 7,9668 | 30/08/2016 | 04/09/2017 | 0,100416 | Europeo | 13,34 | 0,53956 |
| IT0005224180 | Fiat Chrysler Aut. | Call | 9,9586 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,100416 | Europeo | 13,34 | 0,33955 |
| IT0005242612 | Fiat Chrysler Aut. | Call | 12,4482 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,100416 | Europeo | 13,34 | 0,08955 |
| IT0005242620 | Fiat Chrysler Aut. | Call | 12,9461 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,100416 | Europeo | 13,34 | 0,03955 |
| IT0005249286 | Fiat Chrysler Aut. | Call | 11,4523 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,100416 | Europeo | 13,34 | 0,18956 |
| IT0005255267 | Fiat Chrysler Aut. | Call | 10,9544 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,100416 | Europeo | 13,34 | 0,23955 |
| IT0005249344 | Generali | Call | 18 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 15,11 | 0 |
| IT0005249351 | Generali | Call | 19 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 15,11 | 0 |

| Codice ISIN | Attività Sottostante | Call/ Put | Strike Price | Data di Emissione | Data di Scadenza | Multiplo | Stile | Valore di Riferimento Finale | Importo di Liquidazione (EUR) |
|--------------|----------------------|--------------|-----------------|----------------------|---------------------|----------|---------|------------------------------------|-------------------------------------|
| IT0005224271 | Leonardo | Call | 16 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,3 | 0 |
| IT0005242661 | Leonardo | Call | 15 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,3 | 0 |
| IT0005255366 | Leonardo | Call | 17 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,3 | 0 |
| IT0005255374 | Leonardo | Call | 18 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,3 | 0 |
| IT0005255382 | Leonardo | Call | 18,5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,3 | 0 |
| IT0005224321 | Mediaset | Call | 3 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,08 | 0,008 |
| IT0005224354 | Mediobanca | Call | 9 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 8,64 | 0 |
| IT0005249401 | Mediobanca | Call | 10 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 8,64 | 0 |
| IT0005249419 | Mediobanca | Call | 11 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 8,64 | 0 |
| IT0005224396 | Saipem | Call | 6 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,01 | Europeo | 3,086 | 0 |
| IT0005249443 | Saipem | Call | 5,5 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,01 | Europeo | 3,086 | 0 |
| IT0005255523 | Saipem | Call | 4,5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,086 | 0 |
| IT0005255531 | Saipem | Call | 5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 3,086 | 0 |
| IT0005224438 | Saras | Call | 2,2 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 2,06 | 0 |
| IT0005242711 | Saras | Call | 2 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 2,06 | 0,006 |
| IT0005255572 | Saras | Call | 2,3 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 2,06 | 0 |
| IT0005255580 | Saras | Call | 2,5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 2,06 | 0 |
| IT0005224495 | STMicroelectronics | Call | 13 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,75 | 0,175 |
| IT0005242752 | STMicroelectronics | Call | 16 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,75 | 0 |
| IT0005249476 | STMicroelectronics | Call | 17 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,75 | 0 |
| IT0005249484 | STMicroelectronics | Call | 18 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,75 | 0 |
| IT0005255606 | STMicroelectronics | Call | 17,5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 14,75 | 0 |
| IT0005214199 | Telecom Italia | Call | 1 | 30/08/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 0,795 | 0 |
| IT0005224545 | Telecom Italia | Call | 0,9 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 0,795 | 0 |
| IT0005242778 | Telecom Italia | Call | 1,1 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 0,795 | 0 |
| IT0005249500 | Telecom Italia | Call | 0,95 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 0,795 | 0 |
| IT0005255655 | Telecom Italia | Call | 1,05 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 0,795 | 0 |

| Codice ISIN | Attività Sottostante | Call/ Put | Strike Price | Data di Emissione | Data di Scadenza | Multiplo | Stile | Valore di Riferimento Finale | Importo di Liquidazione (EUR) |
|--------------|----------------------|--------------|-----------------|----------------------|---------------------|----------|---------|------------------------------------|-------------------------------------|
| IT0005224578 | Total | Call | 60 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,10 | Europeo | 43,805 | 0 |
| IT0005249542 | Total | Call | 55 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,10 | Europeo | 43,805 | 0 |
| IT0005224628 | Ubi Banca | Call | 2,8593 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,104919 | Europeo | 3,946 | 0,11402 |
| IT0005242810 | Ubi Banca | Call | 3,8124 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,104919 | Europeo | 3,946 | 0,01402 |
| IT0005242828 | Ubi Banca | Call | 4,289 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,104919 | Europeo | 3,946 | 0 |
| IT0005255721 | Ubi Banca | Call | 4,003 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,104919 | Europeo | 3,946 | 0 |
| IT0005255739 | Ubi Banca | Call | 4,4796 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,104919 | Europeo | 3,946 | 0 |
| IT0005214348 | Unicredit | Call | 14,0315 | 30/08/2016 | 04/09/2017 | 0,019955 | Europeo | 17,3 | 0,06522 |
| IT0005214355 | Unicredit | Call | 15,0337 | 30/08/2016 | 04/09/2017 | 0,019955 | Europeo | 17,3 | 0,04522 |
| IT0005249609 | Unicredit | Call | 17 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 17,3 | 0,03 |
| IT0005249617 | Unicredit | Call | 18 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 17,3 | 0 |
| IT0005249625 | Unicredit | Call | 19 | 05/04/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 17,3 | 0 |
| IT0005255796 | Unicredit | Call | 19,5 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 17,3 | 0 |
| IT0005255804 | Unicredit | Call | 20 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 17,3 | 0 |
| IT0005224701 | Unipolsai | Call | 2,5 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 1,939 | 0 |
| IT0005255929 | Unipolsai | Call | 2,4 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 1,939 | 0 |
| IT0005255937 | Unipolsai | Call | 2,6 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 1,939 | 0 |
| IT0005224743 | Volkswagen | Call | 170 | 12/12/2016 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 126,5 | 0 |
| IT0005242885 | Volkswagen | Call | 190 | 07/02/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 126,5 | 0 |
| IT0005255986 | Volkswagen | Call | 160 | 22/05/2017 | 04/09/2017 | 0,1 | Europeo | 126,5 | 0 |