

La presente costituisce una traduzione di cortesia non ufficiale in lingua italiana della versione in lingua inglese dei Final Terms relativi all'emissione "**STANDARD LONG BARRIER DIGITAL PLUS CERTIFICATES with MEMORY EFFECT on MERCEDES-BENZ GROUP AG Share due 31.07.2028**" effettuata a valere sul Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking di Intesa Sanpaolo S.p.A.. Tale traduzione è stata predisposta da Intesa Sanpaolo S.p.A. al fine esclusivo di agevolare la lettura del testo in lingua inglese dei Final Terms da parte dei potenziali investitori. Fermo restando quanto previsto dalla normativa applicabile relativa alla Nota di Sintesi della singola emissione e alla relativa traduzione in lingua italiana, Intesa Sanpaolo S.p.A. non si assume né accetta alcuna responsabilità in merito alla correttezza della traduzione dei Final Terms. Il testo in lingua inglese prevarrà in caso di eventuale divergenza con la traduzione italiana, o di omissioni nell'ambito della stessa.

CONDIZIONI DEFINITIVE

25 giugno 2024

Come modificate e sostituite in data 10 luglio 2024

Intesa Sanpaolo S.p.A.

Codice LEI (Legal Entity Identifier): 2W8N8UU78PMDQKZENC08

**STANDARD LONG BARRIER DIGITAL PLUS CERTIFICATES con EFFETTO MEMORIA
su Azione MERCEDES-BENZ GROUP AG Scadenza 31.07.2028**

nome commerciale: "Intesa Sanpaolo S.p.A. Cash Collect Plus Certificates con Premi Mensili ed Effetto Memoria su Azione Mercedes-Benz Group AG - Scadenza 31.07.2028"

a valere sul Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking

PARTE A – CONDIZIONI CONTRATTUALI

I termini utilizzati nel presente documento devono considerarsi definiti come nei Termini e Condizioni del Prospetto di Base dell'1 marzo 2024, che costituisce un prospetto di base ai sensi del Regolamento Prospetto come successivamente modificato. Il presente documento contiene le Condizioni Definitive dei Titoli descritti ai sensi dell'art. 8(1) del Regolamento Prospetto e deve essere letto congiuntamente al Prospetto di Base. Le informazioni complete relative all'Emittente e all'offerta dei Titoli sono desumibili solamente dalla lettura congiunta delle presenti Condizioni Definitive e del Prospetto di Base. È possibile prendere visione del Prospetto di Base presso la sede legale dell'Emittente e presso gli uffici specificati dell'Agente Principale dei Titoli durante il normale orario di apertura. Il Prospetto di Base è pubblicato sui siti web di Euronext Dublin (www.euronext.com) e dell'Emittente (www.prodottiequotazioni.intesasanpaolo.com). Alle presenti Condizioni Definitive è allegata la nota di sintesi della singola emissione relativa ai Titoli. Nel caso di Titoli ammessi alla negoziazione sul mercato regolamentato di Euronext Dublin, le Condizioni Definitive saranno pubblicate sul sito web di Euronext Dublin e dell'Emittente.

I riferimenti qui contenuti a Condizioni numerate s'intendono ai termini e alle condizioni delle relative serie di Titoli e le parole e le espressioni definite in tali termini e condizioni avranno lo stesso significato nelle presenti Condizioni Definitive nella misura in cui si riferiscono a tali serie di Titoli, salvo ove diversamente specificato.

Le presenti Condizioni Definitive sono riferite alle serie di Titoli definite al successivo paragrafo "Disposizioni specifiche per ciascuna Serie". I riferimenti ai "Titoli" ivi contenuti devono essere considerati riferimenti ai relativi Certificati che sono oggetto delle presenti Condizioni Definitive e i riferimenti ai "Titoli" e al "Titolo" devono essere interpretati di conseguenza.

1. Disposizioni specifiche per ciascuna Serie:

Numero di Serie	Numero di Titoli emessi	Prezzo di Emissione per Titolo
------------------------	--------------------------------	---------------------------------------

	35	Fino a 130.000 ¹	Euro 1.000
2.	Numero di Tranche:	Non applicabile	
3.	Lotto Minimo di Esercizio:	1 (un) <i>Certificate</i> .	
4.	Lotto Minimo di Negoziazione:	1 (un) <i>Certificate</i> .	
5.	Consolidamento:	Non applicabile	
6.	Tipo di Titoli e Attività Sottostante(i):	(a) I Titoli sono <i>Certificates</i> . I <i>Certificates</i> sono Titoli legati ad un'Azione.	
		(b) L'attività finanziaria cui sono collegati i Titoli è l'azione Mercedes-Benz Group AG (Codice ISIN: DE0007100000, Codice Bloomberg: MBG GY <Equity>) (l'"Attività Sottostante" o l'"Azione").	
7.	Attività Sottostante di Riferimento:	Non applicabile	
8.	Tipologia:	<i>Standard Long Certificates</i> .	
9.	(i) Data di Esercizio:	La Data di Esercizio dei Titoli è il 31 luglio 2028.	
	(ii) Orario Limite dell'Avviso di Rinuncia:	Pari all'ultimo Giorno di Valutazione.	
10.	Data di Liquidazione:	La Data di Liquidazione dei Titoli è il 31 luglio 2028.	
		Qualora in un Giorno di Valutazione si verifichi un Evento di Sconvolgimento di Mercato, la Data di Liquidazione verrà postposta di conseguenza. Tale Data di Liquidazione non potrà, in nessun caso, essere postposta oltre il decimo Giorno Lavorativo successivo all'ultimo Giorno di Valutazione.	
11.	Data di Regolamento:	La Data di Regolamento dei Titoli è la Data di Emissione.	
12.	Data di Emissione:	La Data di Emissione è il 31 luglio 2024, ovvero, in caso di posticipo, la diversa data specificata in un avviso pubblicato sul sito web dell'Emittente.	
		In nessun caso la Data di Emissione sarà posticipata oltre il quinto Giorno Lavorativo successivo al 31 luglio 2024.	
13.	Valuta di Emissione:	La Valuta di Emissione è l'Euro.	
14.	Prezzo di Acquisto:	Non applicabile	
15.	Giorno Lavorativo:	Convenzione Giorni Lavorativi <i>Modified Following Unadjusted</i>	
16.	Giorno Lavorativo di Negoziazione:	Convenzione Giorni Lavorativi <i>Modified Following Unadjusted</i>	
17.	Giorno Lavorativo di Liquidazione:	Non applicabile	
18.	Liquidazione:	La liquidazione sarà effettuata mediante pagamento in contanti (Titoli Liquidati in Contanti).	
19.	Tasso di Cambio:	Non applicabile	

¹ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

20.	Valuta di Liquidazione:	La Valuta di Liquidazione ai fini del pagamento dell'Importo di Liquidazione e di ogni altro importo di remunerazione pagabile ai sensi dei Titoli è l'Euro.
21.	Nome e indirizzo dell'Agente di calcolo:	L'Agente di Calcolo è Intesa Sanpaolo S.p.A., con sede legale in Piazza San Carlo, 156, 10121 Torino, Italia.
22.	Mercato(i):	Il relativo Mercato è Xetra.
23.	Fonte di Riferimento:	La Fonte di Riferimento è il relativo Mercato.
24.	Mercato(i) Correlato(i):	Il relativo Mercato Correlato è EUREX.
25.	Caratteristica Futures Contract N-th Near-by:	Non applicabile
26.	Caratteristica Open End:	Non applicabile
27.	Opzione Put:	Non applicabile
28.	Opzione Call:	Non applicabile
29.	Livello Massimo:	Non applicabile
30.	Livello Minimo:	Non applicabile
31.	Importo di Liquidazione:	<p>Alla Data di Liquidazione ciascun Certificato dà diritto al portatore di ricevere un Importo di Liquidazione in Contanti nella Valuta di Liquidazione calcolato dall'Agente di Calcolo secondo la seguente formula e il cui risultato è arrotondato a un centesimo di Euro (0,005 Euro viene arrotondato per eccesso):</p> <p>A. Qualora il Valore di Riferimento Finale sia pari o superiore al Livello Barriera (e dunque l'Evento Barriera <u>non</u> si sia verificato):</p> <p><i>(Percentuale Iniziale x Valore di Riferimento Iniziale x Multiplo) x Lotto Minimo di Esercizio</i></p> <p>B. Qualora il Valore di Riferimento Finale sia inferiore al Livello Barriera (e dunque l'Evento Barriera si sia verificato):</p> <p><i>(Valore di Riferimento Finale x Multiplo) x Lotto Minimo di Esercizio</i></p>
32.	Multiplo:	Il Multiplo da applicarsi è pari al Prezzo di Emissione diviso per il Valore di Riferimento Iniziale.
33.	Beni Rilevanti:	Non applicabile
34.	Entitlement:	Non applicabile
35.	AMF:	Non applicabile
36.	VMF:	Non applicabile
37.	Fattore Index Leverage:	Non applicabile

- | | | |
|-----|--|--|
| 38. | Fattore Constant Leverage: | Non applicabile |
| 39. | Prezzo di Strike: | Non applicabile |
| 40. | Tasso di Conversione: | Non applicabile |
| 41. | Valuta di Riferimento dell'Attività Sottostante: | La Valuta di Riferimento dell'Attività Sottostante è l'Euro. |
| 42. | Opzione Quanto: | Non applicabile |
| 43. | Data(e) di Determinazione: | 26 luglio 2024, 29 luglio 2024, 30 luglio 2024, 31 luglio 2024 e 1 agosto 2024 |
| 44. | Giorno(i) di Valutazione: | 21 luglio 2028, 24 luglio 2028, 25 luglio 2028, 26 luglio 2028 e 27 luglio 2028 |
| 45. | Valore Infragiornaliero: | Non applicabile |
| 46. | Valore di Riferimento: | Ai fini della determinazione dell'Evento Barriera il Valore di Riferimento sarà il Valore di Riferimento Finale. |

Ai fini della determinazione dell'Evento Digital e dell'Effetto Memoria, il Valore di Riferimento sarà calcolato l'ultimo giorno, rispettivamente, del relativo Periodo di Valutazione Digital e del relativo Periodo di Valutazione Memoria. Il Valore di Riferimento è pari alla media aritmetica dei prezzi di chiusura dell'Attività Sottostante, risultanti dalla quotazione effettuata dalla Fonte di Riferimento, determinati dall'Agente di Calcolo in ciascuna data del relativo Periodo di Valutazione Digital e del relativo Periodo di Valutazione Memoria, e calcolata mediante la seguente formula:

$$VR = \frac{1}{x} \times \sum_{z=1}^x \text{Sottostante}_z$$

Dove,

"VR" indica il Valore di Riferimento,

"x" indica il numero di date di tale Periodo di Valutazione Digital e Periodo di Valutazione Memoria ($x = 5$), e

"Sottostante_z" indica il prezzo di chiusura dell'Attività Sottostante nel Giorno Lavorativo di Negoziazione "z" di tale Periodo di Valutazione Digital e Periodo di Valutazione Memoria ($z = 1,2,3,4,5$).

- | | | |
|-----|---------------------------------|---|
| 47. | Valore di Riferimento Iniziale: | Il Valore di Riferimento Iniziale sarà calcolato l'1 agosto 2024 ed è pari alla media aritmetica dei prezzi di chiusura dell'Attività Sottostante risultanti dalla quotazione effettuata dalla Fonte di Riferimento, determinati dall'Agente di Calcolo nelle Date di Determinazione, e calcolata mediante la seguente formula: |
|-----|---------------------------------|---|

$$VRI = \frac{1}{x} \times \sum_{t=1}^x \text{Sottostante}_t$$

Dove,

"**VRI**" indica il Valore di Riferimento Iniziale,

"**x**" indica il numero di Date di Determinazione ($x = 5$), e

"*Sottostante_t*" indica il prezzo di chiusura dell'Attività Sottostante alla Data di Determinazione "*t*" ($t = 1,2,3,4,5$).

- Periodo(i) di Determinazione del Valore di Riferimento Iniziale: Non applicabile
48. Valore di Riferimento Finale: Il Valore di Riferimento Finale sarà calcolato il 27 luglio 2028 ed è pari alla media aritmetica dei prezzi di chiusura dell'Attività Sottostante risultanti dalla quotazione effettuata dalla Fonte di Riferimento, determinati dall'Agente di Calcolo nei Giorni di Valutazione, e calcolata mediante la seguente formula:

$$VRF = \frac{1}{x} \times \sum_{j=1}^x Sottostante_j$$

Dove,

"**VRF**" indica il Valore di Riferimento Finale,

"**x**" indica il numero di Giorni di Valutazione ($x = 5$), e

"*Sottostante_j*" indica il prezzo di chiusura dell'Attività Sottostante nel Giorno di Valutazione "*j*" ($j = 1,2,3,4,5$).

- Periodo(i) di Determinazione del Valore di Riferimento Finale: Non applicabile
49. Caratteristica Best Of: Non applicabile
50. Caratteristica Worst Of: Non applicabile
51. Caratteristica Rainbow: Non applicabile
52. Reverse Split: Non applicabile

DISPOSIZIONI RELATIVE AI CERTIFICATI

Applicabile

53. Performance Cap: Non applicabile
- Performance Floor: Non applicabile
- Fattore di Partecipazione della Performance: Non applicabile
54. Percentuale Iniziale: 100%
55. Fattore di Partecipazione: Non applicabile
56. Fattore di Partecipazione Down: Non applicabile
57. Fattore di Partecipazione Up: Non applicabile
58. Leverage Iniziale: Non applicabile

59.	Evento Barriera:	Applicabile.
		L'Evento Barriera si verificherà qualora l'Agente di Calcolo determini che, nel Periodo di Determinazione dell'Evento Barriera, il Valore di Riferimento Finale sia inferiore al Livello Barriera.
	Periodo(i) di Determinazione dell'Evento Barriera:	27 luglio 2028
	Livello Barriera:	Il Livello Barriera è pari al 60% del Valore di Riferimento Iniziale.
	Livello Barriera Inferiore:	Non applicabile
	Livello Barriera Superiore:	Non applicabile
	Periodo di Selezione Barriera:	Non applicabile
	Periodo di Osservazione Strike:	Non applicabile
	Fattore Air Bag:	Non applicabile
	Livello di Protezione:	Non applicabile
	Percentuale di Protezione:	Non applicabile
	Protezione Spread:	Non applicabile
	Importo di Protezione:	Non applicabile
	Livello di Protezione Dropdown:	Non applicabile
	Importo di Protezione Dropdown:	Non applicabile
	Livello di Protezione Dynamic:	Non applicabile
	Importo Step Up:	Non applicabile
	Importo Sigma:	Non applicabile
	Percentuale Perdita Determinata:	Non applicabile
	Protezione Short:	Non applicabile
	Livello Butterfly:	Non applicabile
60.	Evento Barriera Gap:	Non applicabile
61.	Livello(i) Cap:	Non applicabile
62.	Percentuale Floor:	Non applicabile
63.	Evento Consolidation Floor:	Non applicabile
64.	Importo Barriera Cap:	Non applicabile
65.	Importo Cap Down:	Non applicabile
66.	Percentuale Strike:	Non applicabile

67.	Percentuale Calendar Cap:	Non applicabile
68.	Percentuale Calendar Floor:	Non applicabile
69.	Fattore Gearing:	Non applicabile
70.	Evento One Star:	Non applicabile
71.	Evento Switch:	Non applicabile
72.	Evento _i Multiple Strike:	Non applicabile
73.	Spread:	Non applicabile
74.	Evento Gearing:	Non applicabile
75.	Evento Buffer:	Non applicabile
76.	Performance Globale:	Non applicabile
77.	Mancata Consegna per Illiquidità:	Non applicabile
78.	Percentuale Digital:	Non applicabile
79.	Livello di Liquidazione:	Non applicabile
80.	Importo Combinato:	Non applicabile
81.	Caratteristica Darwin:	Non applicabile

DISPOSIZIONI RELATIVE AGLI IMPORTI DI REMUNERAZIONE E ALL'IMPORTO DI ESERCIZIO ANTICIPATO

Applicabile

82.	Caratteristica Knock-out:	Non applicabile
83.	Caratteristica Knock-in:	Non applicabile
84.	Importo(i) Digital:	Applicabile. L'Importo Digital è pari a Euro 6,00 in relazione a ciascun Periodo di Valutazione Digital.

L'Importo Digital verrà corrisposto al verificarsi del relativo Evento Digital nel relativo Periodo di Valutazione Digital.

Un Evento Digital si verificherà qualora l'Agente di Calcolo determini che, nel relativo Periodo di Valutazione Digital, il Valore di Riferimento sia pari o superiore al Livello Digital. In questo caso, i Portatori avranno diritto di ricevere il pagamento dell'Importo Digital nella relativa Data di Pagamento Digital.

Attività Sottostante: Non applicabile

Livello(i) Digital: In relazione a ciascun Periodo di Valutazione Digital, il Livello Digital è pari al 100% del Valore di Riferimento Iniziale.

Periodo(i) di Valutazione Digital: 19 agosto 2026, 20 agosto 2026, 21 agosto 2026, 24 agosto 2026 e 25 agosto 2026 (il "**Primo Periodo di Valutazione Digital**")

18 settembre 2026, 21 settembre 2026, 22 settembre 2026, 23 settembre 2026 e 24 settembre 2026 (il "**Secondo Periodo di Valutazione Digital**")

20 ottobre 2026, 21 ottobre 2026, 22 ottobre 2026, 23 ottobre 2026 e 26 ottobre 2026 (il "**Terzo Periodo di Valutazione Digital**")

18 novembre 2026, 19 novembre 2026, 20 novembre 2026, 23 novembre 2026 e 24 novembre 2026 (il "**Quarto Periodo di Valutazione Digital**")

17 dicembre 2026, 18 dicembre 2026, 21 dicembre 2026, 22 dicembre 2026 e 23 dicembre 2026 (il "**Quinto Periodo di Valutazione Digital**")

19 gennaio 2027, 20 gennaio 2027, 21 gennaio 2027, 22 gennaio 2027 e 25 gennaio 2027 (il "**Sesto Periodo di Valutazione Digital**")

16 febbraio 2027, 17 febbraio 2027, 18 febbraio 2027, 19 febbraio 2027 e 22 febbraio 2027 (il "**Settimo Periodo di Valutazione Digital**")

17 marzo 2027, 18 marzo 2027, 19 marzo 2027, 22 marzo 2027 e 23 marzo 2027 (il "**Ottavo Periodo di Valutazione Digital**")

20 aprile 2027, 21 aprile 2027, 22 aprile 2027, 23 aprile 2027 e 26 aprile 2027 (il "**Nono Periodo di Valutazione Digital**")

19 maggio 2027, 20 maggio 2027, 21 maggio 2027, 24 maggio 2027 e 25 maggio 2027 (il "**Decimo Periodo di Valutazione Digital**")

18 giugno 2027, 21 giugno 2027, 22 giugno 2027, 23 giugno 2027 e 24 giugno 2027 (il "**Undicesimo Periodo di Valutazione Digital**")

20 luglio 2027, 21 luglio 2027, 22 luglio 2027, 23 luglio 2027 e 26 luglio 2027 (il "**Dodicesimo Periodo di Valutazione Digital**")

19 agosto 2027, 20 agosto 2027, 23 agosto 2027, 24 agosto 2027 e 25 agosto 2027 (il "**Tredicesimo Periodo di Valutazione Digital**")

20 settembre 2027, 21 settembre 2027, 22 settembre 2027, 23 settembre 2027 e 24 settembre 2027 (il "**Quattordicesimo Periodo di Valutazione Digital**")

19 ottobre 2027, 20 ottobre 2027, 21 ottobre 2027, 22 ottobre 2027 e 25 ottobre 2027 (il "**Quindicesimo Periodo di Valutazione Digital**")

18 novembre 2027, 19 novembre 2027, 22 novembre 2027, 23 novembre 2027 e 24 novembre 2027 (il "**Sedicesimo Periodo di Valutazione Digital**")

20 dicembre 2027, 21 dicembre 2027, 22 dicembre 2027, 23 dicembre 2027 e 27 dicembre 2027 (il "**Diciassettesimo Periodo di Valutazione Digital**")

19 gennaio 2028, 20 gennaio 2028, 21 gennaio 2028, 24 gennaio 2028 e 25 gennaio 2028 (il "**Diciottesimo Periodo di Valutazione Digital**")

17 febbraio 2028, 18 febbraio 2028, 21 febbraio 2028, 22 febbraio 2028 e 23 febbraio 2028 (il "**Diciannovesimo Periodo di Valutazione Digital**")

21 marzo 2028, 22 marzo 2028, 23 marzo 2028, 24 marzo 2028 e 27 marzo 2028 (il "**Ventesimo Periodo di Valutazione Digital**")

18 aprile 2028, 19 aprile 2028, 20 aprile 2028, 21 aprile 2028 e 24 aprile 2028 (il "**Ventunesimo Periodo di Valutazione Digital**")

19 maggio 2028, 22 maggio 2028, 23 maggio 2028, 24 maggio 2028 e 25 maggio 2028 (il "**Ventiduesimo Periodo di Valutazione Digital**")

20 giugno 2028, 21 giugno 2028, 22 giugno 2028, 23 giugno 2028 e 26 giugno 2028 (il "**Ventitreesimo Periodo di Valutazione Digital**")

21 luglio 2028, 24 luglio 2028, 25 luglio 2028, 26 luglio 2028 e 27 luglio 2028 (il "**Ventiquattresimo Periodo di Valutazione Digital**")

Data(e) di Pagamento Digital:

31 agosto 2026 in relazione al Primo Periodo di Valutazione Digital (la "**Prima Data di Pagamento Digital**")

30 settembre 2026 in relazione al Secondo Periodo di Valutazione Digital (la "**Seconda Data di Pagamento Digital**")

30 ottobre 2026 in relazione al Terzo Periodo di Valutazione Digital (la "**Terza Data di Pagamento Digital**")

30 novembre 2026 in relazione al Quarto Periodo di Valutazione Digital (la "**Quarta Data di Pagamento Digital**")

31 dicembre 2026 in relazione al Quinto Periodo di Valutazione Digital (la "**Quinta Data di Pagamento Digital**")

29 gennaio 2027 in relazione al Sesto Periodo di Valutazione Digital (la "**Sesta Data di Pagamento Digital**")

26 febbraio 2027 in relazione al Settimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Settima Data di Pagamento Digital**")

31 marzo 2027 in relazione all'Ottavo Periodo di Valutazione Digital (l'"**Ottava Data di Pagamento Digital**")

30 aprile 2027 in relazione al Nono Periodo di Valutazione Digital (la "**Nona Data di Pagamento Digital**")

31 maggio 2027 in relazione al Decimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Decima Data di Pagamento Digital**")

30 giugno 2027 in relazione all'Undicesimo Periodo di Valutazione Digital (l'**Undicesima Data di Pagamento Digital**)

30 luglio 2027 in relazione al Dodicesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Dodicesima Data di Pagamento Digital**")

31 agosto 2027 in relazione al Tredicesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Tredicesima Data di Pagamento Digital**")

30 settembre 2027 in relazione al Quattordicesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Quattordicesima Data di Pagamento Digital**")

29 ottobre 2027 in relazione al Quindicesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Quindicesima Data di Pagamento Digital**")

30 novembre 2027 in relazione al Sedicesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Sedicesima Data di Pagamento Digital**")

31 dicembre 2027 in relazione al Diciassettesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Diciassettesima Data di Pagamento Digital**")

31 gennaio 2028 in relazione al Diciottesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Diciottesima Data di Pagamento Digital**")

29 febbraio 2028 in relazione al Diciannovesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Diciannovesima Data di Pagamento Digital**")

31 marzo 2028 in relazione al Ventesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Ventesima Data di Pagamento Digital**")

28 aprile 2028 in relazione al Ventunesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Ventunesima Data di Pagamento Digital**")

31 maggio 2028 in relazione al Ventiduesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Ventiduesima Data di Pagamento Digital**")

30 giugno 2028 in relazione al Ventitreesimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Ventitreesima Data di Pagamento Digital**")

31 luglio 2028 in relazione al Ventiquattresimo Periodo di Valutazione Digital (la "**Ventiquattresima Data di Pagamento Digital**")

Record Date:

28 agosto 2026 in relazione alla Prima Data di Pagamento Digital

29 settembre 2026 in relazione alla Seconda Data di Pagamento Digital

29 ottobre 2026 in relazione alla Terza Data di Pagamento Digital

27 novembre 2026 in relazione alla Quarta Data di Pagamento Digital")

30 dicembre 2026 in relazione alla Quinta Data di Pagamento Digital

28 gennaio 2027 in relazione alla Sesta Data di Pagamento Digital

25 febbraio 2027 in relazione alla Settima Data di Pagamento Digital

30 marzo 2027 in relazione all'"Ottava Data di Pagamento Digital

29 aprile 2027 in relazione alla Nona Data di Pagamento Digital

28 maggio 2027 in relazione alla Decima Data di Pagamento Digital

29 giugno 2027 in relazione all'Undicesima Data di Pagamento Digital

29 luglio 2027 in relazione alla Dodicesima Data di Pagamento Digital

30 agosto 2027 in relazione alla Tredicesima Data di Pagamento Digital

29 settembre 2027 in relazione alla Quattordicesima Data di Pagamento Digital

28 ottobre 2027 in relazione alla Quindicesima Data di Pagamento Digital

29 novembre 2027 in relazione alla Sedicesima Data di Pagamento Digital")

30 dicembre 2027 in relazione alla Diciassettesima Data di Pagamento Digital

28 gennaio 2028 in relazione alla Diciottesima Data di Pagamento Digital

28 febbraio 2028 in relazione alla Diciannovesima Data di Pagamento Digital

30 marzo 2028 in relazione alla Ventesima Data di Pagamento Digital

27 aprile 2028 in relazione alla Ventunesima Data di Pagamento Digital

30 maggio 2028 in relazione alla Ventiduesima Data di Pagamento Digital

29 giugno 2028 in relazione alla Ventitreesima Data di Pagamento Digital

Caratteristica Digital Combo:	Non applicabile
Caratteristica Cliquet:	Non applicabile
Periodo(i) di Valutazione Cliquet:	Non applicabile
Effetto Consolidamento:	Non applicabile
Livello Consolidamento:	Non applicabile
Periodo(i) di Valutazione Consolidamento:	Non applicabile
Caratteristica Extra Consolidation Digital:	Non applicabile
Livello Extra Consolidation Digital:	Non applicabile
Periodo(i) Extra Consolidation Digital:	Non applicabile
Effetto Memoria:	Applicabile. Qualora l'Agente di Calcolo determini che nel relativo Periodo di Valutazione Memoria, il Valore di Riferimento sia pari o superiore al Livello Memoria, i Portatori avranno diritto di ricevere il pagamento degli Importi Digital non pagati precedentemente per il non verificarsi del relativo Evento Digital (a meno che tali Importi Digital non siano già stati corrisposti a seguito del verificarsi di un Evento Digital in un Periodo di Valutazione Digital precedente).
Livello Memoria:	In relazione a ciascun Periodo di Valutazione Memoria, il Livello Memoria è pari al 100% del Valore di Riferimento Iniziale.
Periodo(i) di Valutazione Memoria:	18 settembre 2026, 21 settembre 2026, 22 settembre 2026, 23 settembre 2026 e 24 settembre 2026 (il " Primo Periodo di Valutazione Memoria ") 20 ottobre 2026, 21 ottobre 2026, 22 ottobre 2026, 23 ottobre 2026 e 26 ottobre 2026 (il " Secondo Periodo di Valutazione Memoria ") 18 novembre 2026, 19 novembre 2026, 20 novembre 2026, 23 novembre 2026 e 24 novembre 2026 (il " Terzo Periodo di Valutazione Memoria ")

17 dicembre 2026, 18 dicembre 2026, 21 dicembre 2026, 22 dicembre 2026 e 23 dicembre 2026 (il "**Quarto Periodo di Valutazione Memoria**")

19 gennaio 2027, 20 gennaio 2027, 21 gennaio 2027, 22 gennaio 2027 e 25 gennaio 2027 (il "**Quinto Periodo di Valutazione Memoria**")

16 febbraio 2027, 17 febbraio 2027, 18 febbraio 2027, 19 febbraio 2027 e 22 febbraio 2027 (il "**Sesto Periodo di Valutazione Memoria**")

17 marzo 2027, 18 marzo 2027, 19 marzo 2027, 22 marzo 2027 e 23 marzo 2027 (il "**Settimo Periodo di Valutazione Memoria**")

20 aprile 2027, 21 aprile 2027, 22 aprile 2027, 23 aprile 2027 e 26 aprile 2027 (il "**Ottavo Periodo di Valutazione Memoria**")

19 maggio 2027, 20 maggio 2027, 21 maggio 2027, 24 maggio 2027 e 25 maggio 2027 (il "**Nono Periodo di Valutazione Memoria**")

18 giugno 2027, 21 giugno 2027, 22 giugno 2027, 23 giugno 2027 e 24 giugno 2027 (il "**Decimo Periodo di Valutazione Memoria**")

20 luglio 2027, 21 luglio 2027, 22 luglio 2027, 23 luglio 2027 e 26 luglio 2027 (il "**Undicesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

19 agosto 2027, 20 agosto 2027, 23 agosto 2027, 24 agosto 2027 e 25 agosto 2027 (il "**Dodicesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

20 settembre 2027, 21 settembre 2027, 22 settembre 2027, 23 settembre 2027 e 24 settembre 2027 (il "**Tredicesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

19 ottobre 2027, 20 ottobre 2027, 21 ottobre 2027, 22 ottobre 2027 e 25 ottobre 2027 (il "**Quattordicesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

18 novembre 2027, 19 novembre 2027, 22 novembre 2027, 23 novembre 2027 e 24 novembre 2027 (il "**Quindicesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

20 dicembre 2027, 21 dicembre 2027, 22 dicembre 2027, 23 dicembre 2027 e 27 dicembre 2027 (il "**Sedicesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

19 gennaio 2028, 20 gennaio 2028, 21 gennaio 2028, 24 gennaio 2028 e 25 gennaio 2028 (il "**Diciassettesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

17 febbraio 2028, 18 febbraio 2028, 21 febbraio 2028, 22 febbraio 2028 e 23 febbraio 2028 (il "**Diciottesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

21 marzo 2028, 22 marzo 2028, 23 marzo 2028, 24 marzo 2028 e 27 marzo 2028 (il "**Diciannovesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

18 aprile 2028, 19 aprile 2028, 20 aprile 2028, 21 aprile 2028 e 24 aprile 2028 (il "**Ventesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

19 maggio 2028, 22 maggio 2028, 23 maggio 2028, 24 maggio 2028 e 25 maggio 2028 (il "**Ventunesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

20 giugno 2028, 21 giugno 2028, 22 giugno 2028, 23 giugno 2028 e 26 giugno 2028 (il "**Ventiduesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

21 luglio 2028, 24 luglio 2028, 25 luglio 2028, 26 luglio 2028 e 27 luglio 2028 (il "**Ventitreesimo Periodo di Valutazione Memoria**")

Effetto Path Dependency:	Non applicabile
Importo Path Dependency:	Non applicabile
85. Caratteristica Restrike:	Non applicabile
86. Importo(i) Plus:	Applicabile. I Portatori hanno diritto di ricevere il pagamento incondizionato degli Importi Plus, pari a Euro 6,00, in ciascuna Data di Pagamento Plus.
Data(e) di Pagamento Plus:	30 agosto 2024 (la " Prima Data di Pagamento Plus ") 30 settembre 2024 (la " Seconda Data di Pagamento Plus ") 31 ottobre 2024 (la " Terza Data di Pagamento Plus ") 29 novembre 2024 (la " Quarta Data di Pagamento Plus ") 31 dicembre 2024 (la " Quinta Data di Pagamento Plus ") 31 gennaio 2025 (la " Sesta Data di Pagamento Plus ") 28 febbraio 2025 (la " Settima Data di Pagamento Plus ") 31 marzo 2025 (l'" Ottava Data di Pagamento Plus ") 30 aprile 2025 (la " Nona Data di Pagamento Plus ") 30 maggio 2025 (la " Decima Data di Pagamento Plus ") 30 giugno 2025 (l'" Undicesima Data di Pagamento Plus ") 31 luglio 2025 (la " Dodicesima Data di Pagamento Plus ") 29 agosto 2025 (la " Tredicesima Data di Pagamento Plus ") 30 settembre 2025 (la " Quattordicesima Data di Pagamento Plus ") 31 ottobre 2025 (la " Quindicesima Data di Pagamento Plus ")

28 novembre 2025 (la "**Sedicesima Data di Pagamento Plus**")

31 dicembre 2025 (la "**Diciassettesima Data di Pagamento Plus**")

30 gennaio 2026 (la "**Diciottesima Data di Pagamento Plus**")

27 febbraio 2026 (la "**Diciannovesima Data di Pagamento Plus**")

31 marzo 2026 (la "**Ventesima Data di Pagamento Plus**")

30 aprile 2026 (la "**Ventunesima Data di Pagamento Plus**")

29 maggio 2026 (la "**Ventiduesima Data di Pagamento Plus**")

30 giugno 2026 (la "**Ventitreesima Data di Pagamento Plus**")

31 luglio 2026 (la "**Ventiquattresima Data di Pagamento Plus**")

Record Date:

29 agosto 2024 in relazione alla Prima Data di Pagamento Plus

27 settembre 2024 in relazione alla Seconda Data di Pagamento Plus

30 ottobre 2024 in relazione alla Terza Data di Pagamento Plus

28 novembre 2024 in relazione alla Quarta Data di Pagamento Plus

30 dicembre 2024 in relazione alla Quinta Data di Pagamento Plus

30 gennaio 2025 in relazione alla Sesta Data di Pagamento Plus

27 febbraio 2025 in relazione alla Settima Data di Pagamento Plus

28 marzo 2025 in relazione all'Ottava Data di Pagamento Plus

29 aprile 2025 in relazione alla Nona Data di Pagamento Plus

29 maggio 2025 in relazione alla Decima Data di Pagamento Plus

27 giugno 2025 in relazione all'Undicesima Data di Pagamento Plus

30 luglio 2025 in relazione alla Dodicesima Data di Pagamento Plus

28 agosto 2025 in relazione alla Tredicesima Data di Pagamento Plus

29 settembre 2025 in relazione alla Quattordicesima Data di Pagamento Plus

30 ottobre 2025 in relazione alla Quindicesima Data di Pagamento Plus

27 novembre 2025 in relazione alla Sedicesima Data di Pagamento Plus

30 dicembre 2025 in relazione alla Diciassettesima Data di Pagamento Plus

29 gennaio 2026 in relazione alla Diciottesima Data di Pagamento Plus

26 febbraio 2026 in relazione alla Diciannovesima Data di Pagamento Plus

30 marzo 2026 in relazione alla Ventesima Data di Pagamento Plus

29 aprile 2026 in relazione alla Ventunesima Data di Pagamento Plus

28 maggio 2026 in relazione alla Ventiduesima Data di Pagamento Plus

29 giugno 2026 in relazione alla Ventitreesima Data di Pagamento Plus

30 luglio 2026 in relazione alla Ventiquattresima Data di Pagamento Plus

87.	Importo(i) Accumulated:	Non applicabile
88.	Importo(i) di Esercizio Anticipato:	Non applicabile
89.	Pagamento Anticipato Parziale del Capitale:	Non applicabile
90.	Importo Cumulated Bonus:	Non applicabile
91.	Evento Coupon:	Non applicabile
92.	Importo Internal Return:	Non applicabile
93.	Importo Participation Remuneration:	Non applicabile
94.	Importo Participation Rebate:	Non applicabile
95.	Importo Variabile:	Non applicabile
96.	Importo Premium Gap:	Non applicabile

DISPOSIZIONI RELATIVE AI WARRANTS

Non applicabile

97.	Tipo di Warrants:	Non applicabile
98.	Importo Nozionale:	Non applicabile
99.	Day Count Fraction:	Non applicabile
100.	Prezzo di Esercizio:	Non applicabile

101.	Premio:	Non applicabile
102.	Evento Barriera:	Non applicabile
	Periodo(i) di Determinazione dell'Evento Barriera:	Non applicabile
	Periodo(i) di Valutazione della Barriera	Non applicabile
	Livello Barriera Inferiore:	Non applicabile
	Livello Barriera Superiore:	Non applicabile
	Importo Anticipato Corridor:	Non applicabile
	Data di Pagamento Anticipato Corridor:	Non applicabile
103.	Percentuale Strike:	Non applicabile
104.	Periodo di Esercizio:	Non applicabile
105.	Numero Massimo di Esercizio:	Non applicabile
106.	Periodo di Determinazione di Liquidazione:	Non applicabile
107.	Data di Determinazione di Liquidazione:	Non applicabile

DISPOSIZIONI GENERALI

108.	Forma dei Titoli:	Titoli al Portatore. Titoli Globali Temporanei scambiabili con un Titolo Globale Permanente che è scambiabile con Titoli Definitivi solo in determinate circostanze specificate nel Titolo Globale Permanente.
109.	Divieto di Vendita alla clientela <i>retail</i> :	Non applicabile

DISTRIBUZIONE

110.	Sindacazione:	I Titoli saranno distribuiti su base non-sindacata.
	(i) Se sindacati, nome e indirizzo dei Collocatori ed impegni di sottoscrizione:	Non applicabile
	(ii) Data dell'Accordo di Sottoscrizione:	Non applicabile
	(iii) Agente stabilizzatore (se nominato):	Non applicabile

Se non sindacati, nome e indirizzo del Collocatore (ove non sia l'Emittente): Non applicabile

Totale commissioni e altri costi:

Il Prezzo di Offerta è comprensivo di:

- commissioni di distribuzione pari al 2,00 per cento del Prezzo di Emissione in relazione alla totalità dei Titoli distribuiti; e
- oneri relativi alla gestione del rischio per il mantenimento delle condizioni dell'Offerta pari allo 0,762 per cento del Prezzo di Emissione.

INFORMAZIONI SUPPLEMENTARI

Esempio(i) di strumenti derivati complessi: Non applicabile

Sottoscritto per conto dell'Emittente:

Da:
Debitamente autorizzato

PARTE B – ALTRE INFORMAZIONI

1. QUOTAZIONE E AMMISSIONE ALLA NEGOZIAZIONE

- (i) Quotazione: Sarà presentata richiesta in Irlanda – Listino Ufficiale di Euronext Dublin.
- (ii) Ammissione alla negoziazione: Sarà presentata richiesta di ammissione dei Titoli alla negoziazione sul mercato regolamentato di Euronext Dublin con effetto a partire dalla Data di Emissione o da una data intorno alla Data di Emissione.
- Sarà altresì presentata richiesta di ammissione dei Titoli alla negoziazione presso il sistema multilaterale di negoziazione SeDeX, organizzato e gestito da Borsa Italiana S.p.A., che non è un mercato regolamentato ai sensi della Direttiva 2014/65/UE come modificata, con effetto a partire dalla Data di Emissione o da una data intorno alla Data di Emissione.
- Successivamente alla Data di Emissione, potrà essere presentata richiesta di quotazione dei Titoli su altre borse valori o mercati regolamentati, o di ammissione alla negoziazione su altre sedi di negoziazione, a scelta dell'Emittente.

2. NOTIFICA

La *Central Bank of Ireland* ha inviato alla Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) un certificato di approvazione che attesta la conformità del Prospetto di Base al Regolamento Prospetto.

3. INTERESSI DI PERSONE FISICHE E GIURIDICHE COINVOLTE NELL'EMISSIONE

Intesa Sanpaolo S.p.A., l'Emittente dei Titoli, agirà altresì in veste di Distributore, pertanto questo comporta un conflitto di interessi.

L'Emittente potrà stipulare accordi di copertura con controparti di mercato in relazione all'emissione dei Titoli ai fini di copertura della propria esposizione finanziaria.

L'Emittente agirà come Agente di Calcolo ai sensi dei Titoli. Si rinvia al fattore di rischio "*Potential Conflicts of Interest*" del Prospetto di Base.

Inoltre, l'Emittente potrà agire come *liquidity provider* (come definito ai sensi delle regole del mercato di riferimento, come di volta in volta modificate) in relazione ai Titoli.

Salvo quanto sopra indicato, ed eccezion fatta per le commissioni e i costi di cui al paragrafo 110 della precedente Parte A, per quanto a conoscenza dell'Emittente, nessun soggetto coinvolto nell'emissione dei Titoli ha un interesse sostanziale in relazione all'Offerta.

4. RAGIONI DELL'OFFERTA, PROVENTI NETTI STIMATI E SPESE TOTALI

- (i) Ragioni dell'offerta: Si veda "Impiego dei Proventi" nel Prospetto di Base.
- (ii) Proventi netti stimati: I proventi netti (risultanti dalla sottrazione delle commissioni e dei costi di cui al paragrafo 110 della Parte A, dal Prezzo di Emissione complessivamente pagato dai Portatori) dell'emissione dei Titoli saranno fino a Euro 126.409.400².
- (iii) Spese totali stimate: Non applicabile

5. TERMINI E CONDIZIONI DELL'OFFERTA

² Come modificato da "116.685.600" a "126.409.400" in data 10 luglio 2024.

Applicabile

Giurisdizione dell'Offerta Pubblica

Repubblica Italiana

Prezzo di Offerta:

Prezzo di Emissione.

Gli investitori dovrebbero considerare che il Prezzo di Offerta è comprensivo delle commissioni di distribuzione e dei costi come sopra indicato al paragrafo 110 della Parte A.

Gli investitori dovrebbero inoltre considerare che, qualora i Titoli siano venduti sul mercato secondario dopo il Periodo di Offerta, le commissioni e i costi di cui sopra non sono considerati ai fini della determinazione del prezzo a cui tali Titoli possono essere venduti sul mercato secondario.

Condizioni cui è subordinata l'offerta:

L'Offerta dei Titoli è subordinata alla loro emissione e al rilascio da parte di Borsa Italiana S.p.A., o da parte di altre piattaforme di negoziazione, prima della Data di Emissione, dell'autorizzazione all'ammissione a negoziazione dei Titoli.

Il Periodo di Offerta, comprese eventuali variazioni, durante il quale verrà effettuata l'offerta e descrizione della procedura di sottoscrizione:

Un'offerta (l'"**Offerta**") dei Titoli sarà effettuata dal Distributore nella Repubblica Italiana in circostanze diverse da quelle previste ai sensi dell'Articolo 1(4) del Regolamento (UE) 2017/1129 (il "**Regolamento Prospetto**") nel periodo dal 26 giugno 2024 sino al 25 luglio 2024 incluso o, limitatamente all'Offerta effettuata per il tramite di consulenti finanziari abilitati all'offerta fuori sede, sino al 18 luglio 2024 incluso o, limitatamente all'Offerta mediante tecniche di comunicazione a distanza, sino all'11 luglio 2024 incluso (il "**Periodo di Offerta**").

I Titoli sono offerti al pubblico in Italia ai sensi degli Articoli 24 e 25 del Regolamento Prospetto.

L'Emittente si riserva il diritto, a sua esclusiva discrezione, di chiudere l'Offerta anticipatamente, anche qualora le sottoscrizioni dei Titoli non raggiungano l'importo massimo di 130.000³ Titoli. La chiusura anticipata dell'Offerta dovrà essere comunicata dall'Emittente tramite avviso da pubblicarsi sul sito web dell'Emittente. Gli effetti della chiusura anticipata dell'Offerta decorrono a partire dalla data indicata in tale avviso.

L'Emittente si riserva il diritto, a propria esclusiva discrezione, di revocare o ritirare l'Offerta e l'emissione dei Titoli in qualsiasi momento prima della Data di Emissione. La revoca o il ritiro dell'Offerta dovranno essere comunicati dall'Emittente tramite pubblicazione di apposito avviso sul sito web dell'Emittente. La revoca/il ritiro dell'Offerta avranno effetto dal momento della pubblicazione. All'atto della revoca o del ritiro dell'Offerta tutte le domande di sottoscrizione diverranno nulle ed inefficaci, senza ulteriore preavviso.

³ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

L'Emittente si riserva la facoltà di prorogare la chiusura del Periodo di Offerta, al fine di estendere il Periodo di Offerta. La proroga del Periodo di Offerta sarà comunicata dall'Emittente mediante pubblicazione di un avviso sul sito web dell'Emittente.

Durante il Periodo di Offerta i potenziali investitori possono sottoscrivere i Titoli presso le filiali del Distributore durante i normali orari di apertura compilando, sottoscrivendo (anche tramite procuratori) e consegnando un'apposita scheda di adesione (la "**Scheda di Adesione**").

La Scheda di Adesione è disponibile presso ciascuna filiale del Distributore.

La sottoscrizione dei Titoli può essere effettuata anche fuori sede per il tramite di consulenti finanziari abilitati all'offerta fuori sede.

La sottoscrizione dei Titoli può essere effettuata anche mediante tecniche di comunicazione a distanza.

Non vi sono limiti al numero di domande di sottoscrizione che possono essere compilate e consegnate dallo stesso potenziale investitore.

Le domande di sottoscrizione possono essere revocate dai potenziali investitori, presentando apposita richiesta presso l'ufficio del Distributore che ha ricevuto la Scheda di Adesione, entro le ore 17:00 del 25 luglio 2024 anche in caso di chiusura anticipata, ovvero, in caso di proroga dell'Offerta, entro l'ultimo giorno dell'Offerta come prorogata.

Una volta scaduti i termini di revoca, la sottoscrizione dei Titoli è irrevocabile.

In aggiunta a quanto sopra indicato, in relazione alla sottoscrizione di Titoli effettuata per il tramite di consulenti finanziari abilitati all'offerta fuori sede, la sottoscrizione sarà effettiva solo dopo sette giorni dal perfezionamento della Scheda di Adesione; prima di tale termine l'investitore ha pieno diritto, senza dover sostenere alcun costo e penali, di revocare la propria sottoscrizione mediante notifica al Distributore e/o al consulente finanziario abilitato all'offerta fuori sede.

Infine, relativamente alla sottoscrizione dei Titoli effettuata tramite tecniche di comunicazione a distanza, la sottoscrizione sarà effettiva solo dopo 14 giorni dal perfezionamento della Scheda di Adesione; prima di tale termine l'investitore classificato come Consumatore ai sensi dell'articolo 67-*duodecies* del D.lgs n. 206/2005 ("**Codice del Consumo**"), ha pieno diritto, senza dover sostenere

alcun costo e penali, di revocare la propria sottoscrizione mediante notifica al Distributore.

L'Emittente potrà, in determinate circostanze, incluso a titolo esemplificativo il deposito di un supplemento al Prospetto di Base, posticipare la Data di Emissione.

Nel caso in cui l'Emittente comunichi che la Data di Emissione sarà posticipata dal 31 luglio 2024 alla diversa data (che cadrà entro un periodo di cinque Giorni Lavorativi successivi al 31 luglio 2024) specificata nel relativo avviso, gli investitori avranno il diritto, senza dover sostenere alcun costo e penali, di revocare la propria sottoscrizione entro tre Giorni Lavorativi precedenti alla Data di Emissione, come posticipata.

Dettagli relativi all'importo minimo e/o massimo delle richieste:

I Titoli possono essere sottoscritti in un lotto minimo di un (1) Certificato e in un numero intero di Titoli superiore a tale ammontare e che sia un multiplo integrale di 1.

Non vi è un limite massimo di richieste entro il numero massimo di Titoli offerti (130.000⁴).

L'Emittente si riserva la facoltà di aumentare, durante il Periodo di Offerta, il numero massimo di Titoli offerti. L'Emittente darà immediatamente avviso di tale aumento mediante pubblicazione di un avviso sul sito web dell'Emittente.

Descrizione della possibilità di ridurre le sottoscrizioni e modalità di rimborso dell'importo delle somme eccedenti pagate dai richiedenti:

Non applicabile

Dettagli relativi alla modalità e alla tempistica di pagamento e di consegna dei Titoli:

Il corrispettivo totale relativo ai Titoli sottoscritti dev'essere versato dall'investitore alla Data di Emissione presso la filiale del Distributore che ha ricevuto la relativa Scheda di Adesione.

I Titoli saranno consegnati ai potenziali detentori alla Data di Emissione, successivamente al pagamento del Prezzo di Offerta, sui conti titoli tenuti, direttamente o indirettamente, dal Distributore presso Euroclear e/o Clearstream.

Modalità e date di comunicazione al pubblico dei risultati dell'offerta:

L'Emittente comunicherà al pubblico i risultati dell'Offerta tramite pubblicazione di un apposito avviso sul suo sito web entro i 5 giorni di apertura del Sistema T2 successivi alla Data di Emissione, come posticipata.

Procedura per l'esercizio di eventuali diritti di prelazione, negoziabilità dei diritti di

Non applicabile

⁴ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

sottoscrizione e trattamento dei diritti di sottoscrizione non esercitati:

Eventuale riserva di *tranche* per alcuni paesi: I Titoli saranno offerti al pubblico esclusivamente in Italia.

I Titoli possono essere sottoscritti anche dagli investitori qualificati, come definiti all'art. 2 (e) del Regolamento Prospetto.

Processo per la notifica ai richiedenti dell'importo assegnato e indicazione della possibilità d'iniziare la contrattazione prima che sia comunicata la notifica: Il Distributore comunicherà ai richiedenti gli importi assegnati.

Le richieste di sottoscrizione verranno soddisfatte fino al raggiungimento del numero massimo di 130.000⁵ Titoli offerti, dopodiché il Distributore non accetterà ulteriori richieste di sottoscrizione ed il Periodo di Offerta sarà chiuso anticipatamente dall'Emittente.

Prima della Data di Emissione, qualora, indipendentemente da quanto detto sopra, l'ammontare complessivo dei Titoli oggetto di richieste di sottoscrizione dovesse superare il numero massimo di 130.000⁶ Titoli offerti, l'Emittente assegnerà i Titoli sulla base di criteri di riparto tali da garantire la parità di trattamento tra tutti i potenziali sottoscrittori.

Importo di eventuali spese o imposte addebitate al sottoscrittore o all'acquirente: L'Emittente non addebiterà ai sottoscrittori dei Titoli alcuna spesa e alcuna imposta.

Gli investitori devono tenere presente che il Prezzo di Offerta è comprensivo delle commissioni di distribuzione e dei costi indicati al precedente paragrafo 110 della Parte A.

Consenso all'uso del Prospetto di Base: Non applicabile

6. DISTRIBUZIONE

(i) Nomi e indirizzi, per quanto a conoscenza dell'Emittente, dei Collocatori / Distributori nei vari paesi in cui ha luogo l'offerta: L'Emittente Intesa Sanpaolo S.p.A., con sede legale in Piazza San Carlo, 156 – 10121 Torino, Italia, agirà quale distributore dei Titoli (il "**Distributore**").

(ii) Nomi e indirizzi dei coordinatori dell'offerta globale e delle singole parti dell'offerta: L'Emittente agirà altresì in veste di Responsabile del Collocamento ai sensi dell'art. 93-*bis* del D. Lgs. 24 febbraio 1998 n. 58 come successivamente modificato ("**Testo Unico della Finanza**").

(iii) Nomi e indirizzi di eventuali altri agenti per i pagamenti e agenti depositari nei singoli paesi (oltre all'Agente Principale per i Titoli): Non applicabile

⁵ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

⁶ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

- (iv) Soggetti che hanno accettato di sottoscrivere l'emissione con impegno irrevocabile e soggetti che hanno accettato di collocare l'emissione senza impegno irrevocabile o su base "*best efforts*": Non applicabile
- (v) Data della firma del contratto di collocamento: Non applicabile

7. INFORMAZIONI SUCCESSIVE ALL'EMISSIONE

L'Emittente non intende fornire eventuali informazioni successive all'emissione salvo che non sia previsto da leggi e regolamenti applicabili.

8. INFORMAZIONI OPERATIVE

- (i) Codice ISIN: XS2842192879
- (ii) *Common Code*: 284219287
- (iii) Altri sistemi di compensazione diversi da Euroclear Bank SA/NV e Clearstream Banking, S.A., e relativi numeri di identificazione: Non applicabile
- (iv) Nomi e indirizzi degli Agenti iniziali per i Titoli: BNP Paribas Securities Services, Luxembourg branch
60, avenue J.F. Kennedy
Lussemburgo
L – 2085 Lussemburgo

PARTE C – NOTA DI SINTESI DELLA SINGOLA EMISSIONE DEI TITOLI

Sezione 1 – Introduzione contenente avvertenze
Denominazione dei Titoli: STANDARD LONG BARRIER DIGITAL PLUS CERTIFICATES con EFFETTO MEMORIA su Azione MERCEDES-BENZ GROUP AG Scadenza 31.07.2028 (Codice ISIN XS2842192879)
Emittente: Intesa Sanpaolo S.p.A. (Intesa Sanpaolo , la Banca o l' Emittente) Indirizzo: Piazza San Carlo 156, 10121 Torino, Italia Numero di telefono: +39 011 555 1 Sito web: www.prodottiequotazioni.intesasanpaolo.com Codice identificativo del soggetto giuridico (LEI): 2W8N8UU78PMDQKZENC08
Autorità competente: <i>Central Bank of Ireland (CBI)</i> , New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1 D01 F7X3, Irlanda. Numero di telefono: +353 (0)1 224 6000.
Data di approvazione del Prospetto di Base: Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking approvato dalla CBI l'1 marzo 2024.
La presente Nota di Sintesi deve essere letta come introduzione al Prospetto di Base. Qualsiasi decisione d'investimento nei Titoli dovrebbe basarsi sull'esame da parte dell'investitore del Prospetto di Base completo. L'investitore potrebbe incorrere in una perdita totale o parziale del capitale investito. Qualora sia presentato un ricorso dinanzi all'autorità giudiziaria in merito alle informazioni contenute nel Prospetto di Base, l'investitore ricorrente potrebbe essere tenuto, a norma del diritto nazionale degli Stati membri, a sostenere le spese di traduzione del Prospetto di Base (inclusi eventuali supplementi e le Condizioni Definitive) prima dell'inizio del procedimento. La responsabilità civile incombe solo sulle persone che hanno presentato la nota di sintesi, comprese le sue eventuali traduzioni, ma soltanto se la Nota di Sintesi risulti fuorviante, imprecisa o incoerente se letta insieme con le altre parti del Prospetto di Base o non offra, se letta congiuntamente alle altre sezioni del Prospetto di Base, le informazioni fondamentali per aiutare gli investitori a valutare l'opportunità di investire nei Titoli.
Stare per acquistare un prodotto che non è semplice e può essere di difficile comprensione.
Sezione 2 – Informazioni fondamentali concernenti l'Emittente
Chi è l'emittente dei titoli? L'Emittente è Intesa Sanpaolo S.p.A., iscritto nel Registro delle Imprese di Torino al n. 00799960158 e all'Albo Nazionale delle Banche al numero meccanografico 5361 ed è la capogruppo del Gruppo Intesa Sanpaolo. Intesa Sanpaolo S.p.A. opera ed è soggetta alla Normativa Bancaria.
Domicilio e forma giuridica, codice LEI, ordinamento in base alla quale opera e paese in cui ha sede Il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) di Intesa Sanpaolo è 2W8N8UU78PMDQKZENC08. L'Emittente è una banca italiana costituita in forma di società per azioni. La sede legale e amministrativa dell'Emittente è in Piazza San Carlo 156, 10121 Torino, Italia. L'Emittente è costituito e opera ai sensi della legge italiana. L'Emittente, sia in quanto banca sia in quanto capogruppo del Gruppo Intesa Sanpaolo, è assoggettato a vigilanza prudenziale da parte della Banca d'Italia e della Banca Centrale Europea.
Attività principali L'Emittente è un istituto bancario che svolge attività di investment banking. L'Emittente offre una vasta gamma di servizi relativi ai mercati di capitali, investment banking e servizi di credito specifici ad una clientela diversificata, inclusi banche, società, investitori istituzionali, enti e organizzazioni pubbliche. L'Emittente è la capogruppo del Gruppo Intesa Sanpaolo che opera mediante sei divisioni: la divisione Banca dei Territori, la divisione <i>Corporate and Investment Banking</i> , la divisione <i>International Subsidiary Banks</i> , la divisione <i>Private Banking</i> , la divisione <i>Asset Management</i> e la divisione <i>Insurance</i> .
Maggiori azionisti, compreso se è direttamente o indirettamente posseduto o controllato e da quali soggetti Alla data del 15 dicembre 2023, l'azionariato dell'Emittente risulta così composto (titolari di quote superiori al 3%): Fondazione Compagnia di San Paolo (azioni ordinarie: 1.188.947.304; di possesso: 6,503%); Fondazione Cariplo (azioni ordinarie: 961.333.900; di possesso: 5,258%).
Identità dei suoi principali amministratori delegati L'amministratore delegato dell'Emittente è Carlo Messina (<i>Chief Executive Officer</i>).
Identità dei suoi revisori legali EY S.p.A., con sede legale in Via Lombardia, 31 – 00187 Roma, ha ricevuto dall'Emittente l'incarico di revisione legale del proprio bilancio per gli esercizi 2021-2029.
Quali sono le informazioni finanziarie fondamentali relative all'Emittente?

Conto Economico Consolidato						
	Per l'anno concluso al			Per i sei mesi chiusi al		
<i>Milioni di Euro, salvo dove indicato</i>	31.12.23 ⁷ <i>Non revisionato</i>	31.12.22 <i>Revisionato</i>	31.12.21 <i>Revisionato</i>	30.06.23 <i>Non revisionato</i>	30.06.22 <i>Non revisionato</i> ⁸	
Margine d'interesse	non disponibile	9.685	7.993	7.932	5.160	
Commissioni nette	non disponibile	8.577	9.364	3.940	4.405	
Risultato netto dell'attività di negoziazione	non disponibile	(149)	503	69	179	
Rettifiche/riprese di valore nette per rischio di credito	non disponibile	(2.624)	(2.843)	(725)	(1.319)	
Risultato netto della gestione finanziaria e assicurativa	non disponibile	18.483	17.774	11.470	9.028	
Utile (Perdita) d'esercizio di pertinenza della capogruppo	7.724	4.354	4.185	4.222	2.346	
Stato Patrimoniale Consolidato						
	Per l'anno concluso al			Per i sei mesi/anno chiusi/o al		Valore come risultato dal processo di revisione e valutazione prudenziale (requisito 'SREP' per il 2023)
<i>Milioni di Euro, salvo dove indicato</i>	31.12.23 ⁷ <i>Non revisionato</i>	31.12.22 <i>Revisionato</i>	31.12.21 <i>Revisionato</i>	30.06.23 <i>Non revisionato</i>	31.12.22 <i>Non revisionato</i> ⁸	
Totale attività	963.570	975.683	1.069.003	955.205	974.587	non applicabile
Debito di primo rango senior (titoli emessi) ⁹	non disponibile	63.605	73.959	83.145	64.926	non applicabile
Passività subordinate (titoli emessi)	non disponibile	12.474	12.599	13.482	12.474	non applicabile
Attività finanziarie valutate al costo ammortizzato – Crediti verso la clientela	non disponibile	495.194	504.929	494.028	495.197	non applicabile
Passività finanziarie valutate al costo ammortizzato – Debiti verso clientela	non disponibile	454.025	458.239	438.677	454.595	non applicabile
Capitale	10.369	10.369	10.084	10.369	10.369	non applicabile
Crediti deteriorati	4.965	5.496	7.077	5.298	5.496	non applicabile

⁷ Le informazioni finanziarie relative al 31 dicembre 2023 sono state estratte dal comunicato stampa di Intesa Sanpaolo S.p.A. del 6 febbraio 2024 intitolato "Intesa Sanpaolo: Risultati Consolidati al 31 dicembre 2023" (il "**Comunicato Stampa dei Risultati 2023**"). L'Emittente conferma che i risultati non revisionati e gli altri dati contenuti nel Comunicato Stampa dei Risultati 2023 sono coerenti con le cifre corrispondenti che saranno contenute nel bilancio consolidato dell'Emittente al 31 dicembre 2023. Le informazioni finanziarie indicate come "non disponibile" non sono state incluse nel Comunicato Stampa dei Risultati 2023.

⁸ Modificato a seguito dell'applicazione dell'IFRS 17 e IFRS 9 per le società assicurative del Gruppo.

⁹ Titoli emessi non contabilizzati come debito subordinato.

Common Equity Tier 1 capital (CET1) ratio (%)	13,7% ¹⁰	13,5% ¹⁰	14,0% ¹⁰	13,7% ¹¹	13,5% ¹¹	8,83% ¹²
Total Capital Ratio	19,2% ¹⁰	19,0% ¹⁰	18,9% ¹⁰	19,3% ¹¹	19,0% ¹¹	non disponibile

Quali sono i principali rischi specifici dell'Emittente?

Rischio connesso all'esposizione al debito sovrano

Le tensioni sui mercati dei titoli di Stato e la loro volatilità, nonché il declassamento del rating dell'Italia o la previsione che tale declassamento possa verificarsi, potrebbero avere effetti negativi sull'attivo, sulla situazione economica e/o finanziaria, sui risultati operativi e sulle prospettive della Banca. I risultati del Gruppo Intesa Sanpaolo sono e saranno esposti al debito sovrano, in particolare a quello italiano e a quello di alcuni importanti Paesi europei.

Rischi connessi ai procedimenti giudiziari

Il rischio connesso a procedimenti giudiziari consiste nella possibilità che la Banca sia obbligata a sostenere i costi derivanti da esiti sfavorevoli degli stessi.

Rischi connessi alla crisi economico-finanziaria e all'impatto delle attuali incertezze del contesto macroeconomico

Lo sviluppo futuro del contesto macroeconomico può essere considerato un rischio in quanto può produrre effetti e dinamiche negative sulla situazione economica, patrimoniale e finanziaria della Banca e/o del Gruppo. Eventuali variazioni negative dei fattori che incidono nel contesto macroeconomico, in particolare in periodi di crisi economico-finanziaria, potrebbero comportare per la Banca e/o il Gruppo perdite, aumenti dei costi di finanziamento e riduzioni di valore delle attività detenute, con un potenziale impatto negativo sulla liquidità della Banca e/o del Gruppo e sulla sua solidità finanziaria.

Rischio di credito

L'attività economica e finanziaria e la solidità della Banca dipendono dall'affidabilità creditizia dei debitori. La Banca è esposta ai tradizionali rischi connessi all'attività creditizia. Pertanto, la violazione da parte dei clienti dei contratti stipulati e degli obblighi ad essi sottostanti, o l'eventuale carenza di informativa o l'inesattezza delle informazioni da essi fornite in merito alla rispettiva posizione finanziaria e creditizia, potrebbe avere effetti negativi sulla situazione economica e/o finanziaria della Banca.

Rischio di mercato

Il rischio di mercato consiste nel rischio di subire perdite di valore su strumenti finanziari, inclusi i titoli di Stati sovrani detenuti dalla Banca, a causa dell'andamento delle variabili di mercato (a titolo esemplificativo e non esaustivo, tassi di interesse, prezzi dei titoli, tassi di cambio), che potrebbero determinare un deterioramento della solidità finanziaria della Banca e/o del Gruppo. Tale deterioramento potrebbe essere prodotto da effetti negativi sul conto economico derivanti da posizioni detenute a fini di negoziazione, così come da variazioni negative della riserva FVOCI (*Fair Value through Other Comprehensive Income*), generate da posizioni classificate come attività finanziarie valutate al *fair value*, con un impatto sulla redditività complessiva.

Rischio di liquidità di Intesa Sanpaolo

Sebbene la Banca monitori costantemente il proprio rischio di liquidità, qualsiasi sviluppo negativo della situazione di mercato e del contesto economico generale e/o del merito creditizio della Banca, può avere effetti negativi sulle attività e sulla situazione economica e/o finanziaria della Banca e del Gruppo Intesa Sanpaolo. In particolare, alla luce di quanto emerso dal terzo rapporto dell'EBA sul monitoraggio del LCR e del NSFR¹³, l'Emittente rimane attento all'evoluzione del mercato dei finanziamenti per garantire che le proprie strategie di rifinanziamento ordinario e la normale attività non siano influenzati dall'effetto cumulativo della scadenza di tutti i restanti finanziamenti della banca centrale e da ulteriori deflussi dovuti all'impatto di scenari avversi sulla liquidità del mercato. Il rischio di liquidità è il rischio che la Banca non sia in grado di soddisfare i propri obblighi di pagamento alla scadenza, sia per l'incapacità di reperire fondi sul mercato (*funding liquidity risk*) che per la difficoltà di smobilizzare le proprie attività (*market liquidity risk*).

Rischio operativo

La Banca è esposta a diverse categorie di rischio operativo strettamente connesse alla sua attività, tra le quali, a titolo esemplificativo e non esaustivo: frodi da parte di soggetti esterni, frodi o perdite derivanti dall'infedeltà dei dipendenti e/o dalla violazione delle procedure di controllo, errori operativi, difetti o malfunzionamenti dei sistemi informatici o di telecomunicazione, attacchi con virus informatici, inadempienze dei fornitori rispetto ai loro obblighi contrattuali, attacchi terroristici e calamità naturali. Il verificarsi di uno o più di tali rischi può avere significativi effetti negativi sull'attività, sui risultati operativi e sulla situazione economica e finanziaria della Banca.

Rischio connesso all'evoluzione della regolamentazione del settore bancario e alle modifiche alla regolamentazione relativa alla risoluzione delle crisi bancarie

La Banca è soggetta ad una complessa e rigorosa regolamentazione, nonché all'attività di vigilanza svolta dalle istituzioni competenti (in particolare, la Banca Centrale Europea, la Banca d'Italia e la CONSOB). Sia tale regolamentazione che l'attività di vigilanza sono soggette, rispettivamente, ad un continuo aggiornamento e all'evoluzione della prassi. Inoltre, in quanto Banca quotata, la Banca è tenuta a rispettare le ulteriori disposizioni emanate dalla CONSOB. La Banca, oltre alle norme sovranazionali e nazionali e alle norme primarie o regolamentari del settore finanziario e bancario, è soggetta anche a specifiche norme in materia di antiriciclaggio, usura e tutela dei consumatori. Sebbene la Banca si impegni a rispettare l'insieme delle norme e dei regolamenti, eventuali modifiche delle norme e/o modifiche dell'interpretazione e/o dell'attuazione delle stesse da parte delle autorità competenti potrebbero comportare nuovi oneri e obblighi per la Banca, con possibili impatti negativi sui risultati operativi e sulla situazione economica

¹⁰ Fully loaded (il periodo transitorio IFRS 9 è terminato al 31 dicembre 2022, pertanto gli importi riportati nella colonna al 31 dicembre 2023 sono confrontati con i precedenti periodi "IFRS 9 Fully loaded").

¹¹ Fully loaded (il periodo transitorio IFRS 9 è terminato al 31 dicembre 2022, pertanto gli importi riportati nella colonna al 30 giugno 2023 sono confrontati con il precedente periodo "IFRS 9 Fully loaded").

¹² In applicazione della disciplina introdotta dalla BCE ed entrata in vigore il 12 marzo 2020. Il requisito SREP è comprensivo di *Capital Conservation Buffer*, *O-SII Buffer* e *Countercyclical Capital Buffer*. Il *Countercyclical Capital Buffer* è calcolato tenendo conto dell'esposizione al 31 dicembre 2023 nei vari Paesi in cui il Gruppo è presente, nonché dei rispettivi requisiti stabiliti dalle autorità nazionali competenti e relativi al 2025, ove disponibili, o al più recente aggiornamento del periodo di riferimento (il requisito è stato fissato a zero per cento in Italia per i primi tre mesi del 2023).

¹³ Report EBA sul "Monitoraggio dell'attuazione del coefficiente di copertura della liquidità e del coefficiente netto di finanziamento stabile nell'UE" del 15 giugno 2023.

e finanziaria della Banca.

Sezione 3 – Informazioni fondamentali sui Titoli

Tipologia, classe e codice ISIN

I Titoli sono Certificati. I Titoli sono emessi al portatore ("**Titoli al Portatore**").
I Certificati sono liquidati in contanti.
Il Codice ISIN dei Certificati è XS2842192879.

Valuta, valore nominale dei titoli emessi e durata dei titoli

Il prezzo di emissione dei Certificati è pari a Euro 1.000 (il "**Prezzo di Emissione**").
I Titoli sono emessi in Euro (la "**Valuta di Emissione**").
La Valuta di Liquidazione è l'Euro.
Ciascun Certificato sarà esercitato automaticamente alla Data di Esercizio. La Data di Esercizio e la Data di Liquidazione è il 31 luglio 2028.

Diritti connessi ai titoli

I Certificati e qualsiasi altra obbligazione extracontrattuale derivante da o relativa ai Certificati sarà disciplinata e interpretata in base alla legge inglese.
I Certificati danno diritto al portatore di ricevere dall'Emittente i seguenti importi.

IMPORTI DI REMUNERAZIONE

I Certificati prevedono i seguenti importi di remunerazione.

IMPORTI DIGITAL

I Certificati prevedono il pagamento dell'Importo Digital al verificarsi del relativo Evento Digital.

Un Evento Digital si verificherà qualora il Valore di Riferimento, nel relativo Periodo di Valutazione Digital, sia superiore o pari al Livello Digital.
I Periodi di Valutazione Digital sono: 19 agosto 2026, 20 agosto 2026, 21 agosto 2026, 24 agosto 2026 e 25 agosto 2026 (il "**Primo Periodo di Valutazione Digital**"); 18 settembre 2026, 21 settembre 2026, 22 settembre 2026, 23 settembre 2026 e 24 settembre 2026 (il "**Secondo Periodo di Valutazione Digital**"); 20 ottobre 2026, 21 ottobre 2026, 22 ottobre 2026, 23 ottobre 2026 e 26 ottobre 2026 (il "**Terzo Periodo di Valutazione Digital**"); 18 novembre 2026, 19 novembre 2026, 20 novembre 2026, 23 novembre 2026 e 24 novembre 2026 (il "**Quarto Periodo di Valutazione Digital**"); 17 dicembre 2026, 18 dicembre 2026, 21 dicembre 2026, 22 dicembre 2026 e 23 dicembre 2026 (il "**Quinto Periodo di Valutazione Digital**"); 19 gennaio 2027, 20 gennaio 2027, 21 gennaio 2027, 22 gennaio 2027 e 25 gennaio 2027 (il "**Sesto Periodo di Valutazione Digital**"); 16 febbraio 2027, 17 febbraio 2027, 18 febbraio 2027, 19 febbraio 2027 e 22 febbraio 2027 (il "**Settimo Periodo di Valutazione Digital**"); 17 marzo 2027, 18 marzo 2027, 19 marzo 2027, 22 marzo 2027 e 23 marzo 2027 (il "**Ottavo Periodo di Valutazione Digital**"); 20 aprile 2027, 21 aprile 2027, 22 aprile 2027, 23 aprile 2027 e 26 aprile 2027 (il "**Nono Periodo di Valutazione Digital**"); 19 maggio 2027, 20 maggio 2027, 21 maggio 2027, 24 maggio 2027 e 25 maggio 2027 (il "**Decimo Periodo di Valutazione Digital**"); 18 giugno 2027, 21 giugno 2027, 22 giugno 2027, 23 giugno 2027 e 24 giugno 2027 (il "**Undicesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 20 luglio 2027, 21 luglio 2027, 22 luglio 2027, 23 luglio 2027 e 26 luglio 2027 (il "**Dodicesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 19 agosto 2027, 20 agosto 2027, 23 agosto 2027, 24 agosto 2027 e 25 agosto 2027 (il "**Tredicesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 20 settembre 2027, 21 settembre 2027, 22 settembre 2027, 23 settembre 2027 e 24 settembre 2027 (il "**Quattordicesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 19 ottobre 2027, 20 ottobre 2027, 21 ottobre 2027, 22 ottobre 2027 e 25 ottobre 2027 (il "**Quindicesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 18 novembre 2027, 19 novembre 2027, 22 novembre 2027, 23 novembre 2027 e 24 novembre 2027 (il "**Sedicesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 20 dicembre 2027, 21 dicembre 2027, 22 dicembre 2027, 23 dicembre 2027 e 27 dicembre 2027 (il "**Diciassettesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 19 gennaio 2028, 20 gennaio 2028, 21 gennaio 2028, 24 gennaio 2028 e 25 gennaio 2028 (il "**Diciottesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 17 febbraio 2028, 18 febbraio 2028, 21 febbraio 2028, 22 febbraio 2028 e 23 febbraio 2028 (il "**Diciannovesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 21 marzo 2028, 22 marzo 2028, 23 marzo 2028, 24 marzo 2028 e 27 marzo 2028 (il "**Ventesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 18 aprile 2028, 19 aprile 2028, 20 aprile 2028, 21 aprile 2028 e 24 aprile 2028 (il "**Ventesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 19 maggio 2028, 22 maggio 2028, 23 maggio 2028, 24 maggio 2028 e 25 maggio 2028 (il "**Ventiduesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 20 giugno 2028, 21 giugno 2028, 22 giugno 2028, 23 giugno 2028 e 26 giugno 2028 (il "**Ventitreesimo Periodo di Valutazione Digital**"); 21 luglio 2028, 24 luglio 2028, 25 luglio 2028, 26 luglio 2028 e 27 luglio 2028 (il "**Ventiquattresimo Periodo di Valutazione Digital**").

Il Livello Digital è pari al 100% del Valore di Riferimento Iniziale (il "**Livello Digital**") in relazione a ciascun Periodo di Valutazione Digital. L'Importo Digital è pari a Euro 6,00 in relazione a ciascun Periodo di Valutazione Digital.

In relazione agli Importi Digital, è prevista la seguente caratteristica:

Effetto Memoria

Qualora il Valore di Riferimento nei seguenti periodi: 18 settembre 2026, 21 settembre 2026, 22 settembre 2026, 23 settembre 2026 e 24 settembre 2026 (il "**Primo Periodo di Valutazione Memoria**"); 20 ottobre 2026, 21 ottobre 2026, 22 ottobre 2026, 23 ottobre 2026 e 26 ottobre 2026 (il "**Secondo Periodo di Valutazione Memoria**"); 18 novembre 2026, 19 novembre 2026, 20 novembre 2026, 23 novembre 2026 e 24 novembre 2026 (il "**Terzo Periodo di Valutazione Memoria**"); 17 dicembre 2026, 18 dicembre 2026, 21 dicembre 2026, 22 dicembre 2026 e 23 dicembre 2026 (il "**Quarto Periodo di Valutazione Memoria**"); 19 gennaio 2027, 20 gennaio 2027, 21 gennaio 2027, 22 gennaio 2027 e 25 gennaio 2027 (il "**Quinto Periodo di Valutazione Memoria**"); 16 febbraio 2027, 17 febbraio 2027, 18 febbraio 2027, 19 febbraio 2027 e 22 febbraio 2027 (il "**Sesto Periodo di Valutazione Memoria**"); 17 marzo 2027, 18 marzo 2027, 19 marzo 2027, 22 marzo 2027 e 23 marzo 2027 (il "**Settimo Periodo di Valutazione Memoria**"); 20 aprile 2027, 21 aprile 2027, 22 aprile 2027, 23 aprile 2027 e 26 aprile 2027 (il "**Ottavo Periodo di Valutazione Memoria**"); 19 maggio 2027, 20 maggio 2027, 21 maggio 2027, 24 maggio 2027 e 25 maggio 2027 (il "**Nono Periodo di Valutazione Memoria**"); 18 giugno 2027, 21 giugno 2027, 22 giugno 2027, 23 giugno 2027 e 24 giugno 2027 (il "**Decimo Periodo di Valutazione Memoria**"); 20 luglio 2027, 21 luglio 2027, 22 luglio 2027, 23 luglio 2027 e 26 luglio 2027 (il "**Undicesimo Periodo di Valutazione Memoria**"); 19 agosto 2027, 20 agosto 2027, 23 agosto 2027, 24 agosto 2027 e 25 agosto 2027 (il "**Dodicesimo Periodo di Valutazione Memoria**"); 20 settembre 2027, 21 settembre 2027, 22 settembre 2027, 23

settembre 2027 e 24 settembre 2027 (il "Tredicesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 19 ottobre 2027, 20 ottobre 2027, 21 ottobre 2027, 22 ottobre 2027 e 25 ottobre 2027 (il "Quattordicesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 18 novembre 2027, 19 novembre 2027, 22 novembre 2027, 23 novembre 2027 e 24 novembre 2027 (il "Quindicesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 20 dicembre 2027, 21 dicembre 2027, 22 dicembre 2027, 23 dicembre 2027 e 27 dicembre 2027 (il "Sedicesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 19 gennaio 2028, 20 gennaio 2028, 21 gennaio 2028, 24 gennaio 2028 e 25 gennaio 2028 (il "Diciassettesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 17 febbraio 2028, 18 febbraio 2028, 21 febbraio 2028, 22 febbraio 2028 e 23 febbraio 2028 (il "Diciottesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 21 marzo 2028, 22 marzo 2028, 23 marzo 2028, 24 marzo 2028 e 27 marzo 2028 (il "Diciannovesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 18 aprile 2028, 19 aprile 2028, 20 aprile 2028, 21 aprile 2028 e 24 aprile 2028 (il "Ventesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 19 maggio 2028, 22 maggio 2028, 23 maggio 2028, 24 maggio 2028 e 25 maggio 2028 (il "Ventunesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 20 giugno 2028, 21 giugno 2028, 22 giugno 2028, 23 giugno 2028 e 26 giugno 2028 (il "Ventiduesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 21 luglio 2028, 24 luglio 2028, 25 luglio 2028, 26 luglio 2028 e 27 luglio 2028 (il "Ventitreesimo Periodo di Valutazione Memoria"); 20 giugno 2028, 21 giugno 2028, 22 giugno 2028, 23 giugno 2028 e 26 giugno 2028 (il "Ventitreesimo Periodo di Valutazione Memoria") sia superiore o pari al 100% del Valore di Riferimento Iniziale (il "Livello Memoria") in relazione a ciascun Periodo di Valutazione Memoria, l'investitore riceverà gli Importi Digital precedentemente non corrisposti (a meno che tali Importi Digital non siano già stati corrisposti a seguito del verificarsi di un Evento Digital in un precedente Periodo di Valutazione Digital).

IMPORTI PLUS

I Certificati prevedono il pagamento incondizionato degli Importi Plus, che non sono legati alla performance dell'Attività Sottostante. Gli Importi Plus sono pari a Euro 6,00, e saranno pagati nelle seguenti date: 30 agosto 2024, 30 settembre 2024, 31 ottobre 2024, 29 novembre 2024, 31 dicembre 2024, 31 gennaio 2025, 28 febbraio 2025, 31 marzo 2025, 30 aprile 2025, 30 maggio 2025, 30 giugno 2025, 31 luglio 2025, 29 agosto 2025, 30 settembre 2025, 31 ottobre 2025, 28 novembre 2025, 31 dicembre 2025, 30 gennaio 2026, 27 febbraio 2026, 31 marzo 2026, 30 aprile 2026, 29 maggio 2026, 30 giugno 2026 e 31 luglio 2026 (le "Date di Pagamento Plus").

IMPORTO DI LIQUIDAZIONE

I Portatori riceveranno alla Data di Liquidazione, per ciascun Lotto Minimo di Esercizio, il pagamento dell'Importo di Liquidazione (ove positivo) determinato come segue.

CERTIFICATI STANDARD LONG

MODALITÀ DI CALCOLO APPLICABILI IN CASO DI PERFORMANCE POSITIVA E NEGATIVA DELL'ATTIVITÀ SOTTOSTANTE (EVENTO BARRIERA NON VERIFICATOSI)

L'investitore riceverà un importo legato ad una percentuale del Valore di Riferimento Iniziale, pari a 100% (la "Percentuale Iniziale").

MODALITÀ DI CALCOLO APPLICABILI IN CASO DI PERFORMANCE NEGATIVA DELL'ATTIVITÀ SOTTOSTANTE (EVENTO BARRIERA VERIFICATOSI)

L'Evento Barriera si verificherà qualora nell'ultimo Giorno di Valutazione, il Valore di Riferimento Finale sia inferiore al Livello Barriera pari a 60% del Valore di Riferimento Iniziale.

Qualora si verifichi l'Evento Barriera, l'Importo di Liquidazione sarà legato alla performance dell'Attività Sottostante (l'investimento nel Certificato equivarrà cioè a un investimento diretto nell'Attività Sottostante) e pertanto sarà esposto al rischio di perdita parziale o totale del capitale investito.

Per le finalità di cui sopra si applica quanto segue:

Ai fini della determinazione dell'Evento Barriera il Valore di Riferimento sarà il Valore di Riferimento Finale.

Ai fini della determinazione dell'Evento Digital e dell'Effetto Memoria, il Valore di Riferimento sarà calcolato l'ultimo giorno, rispettivamente, del relativo Periodo di Valutazione Digital e del relativo Periodo di Valutazione Memoria. Il Valore di Riferimento è pari alla media aritmetica dei prezzi di chiusura dell'Attività Sottostante, determinati dall'Agente di Calcolo in ciascuna data del relativo Periodo di Valutazione Digital e del relativo Periodo di Valutazione Memoria.

Il Valore di Riferimento Iniziale sarà calcolato l'1 agosto 2024 ed è pari alla media aritmetica dei prezzi di chiusura dell'Attività Sottostante, determinati dall'Agente di Calcolo il 26 luglio 2024, 29 luglio 2024, 30 luglio 2024, 31 luglio 2024 e 1 agosto 2024 (le "Date di Determinazione").

Il Valore di Riferimento Finale sarà calcolato il 27 luglio 2028 ed è pari alla media aritmetica dei prezzi di chiusura dell'Attività Sottostante, determinati dall'Agente di Calcolo il 21 luglio 2028, 24 luglio 2028, 25 luglio 2028, 26 luglio 2028 e 27 luglio 2028 (i "Giorni di Valutazione").

L'Attività Sottostante è l'azione Mercedes-Benz Group AG (Codice ISIN: DE0007100000, Codice Bloomberg: MBG GY <Equity>) ("Attività Sottostante" o l'"Azione").

In relazione all'Attività Sottostante, alcune informazioni storiche (comprese le performance passate della stessa) sono reperibili attraverso i principali data providers, quali Bloomberg e Reuters. Informazioni riguardanti l'Attività Sottostante sono altresì reperibili sul sito web del relativo emittente www.group.mercedes-benz.com.

Rango dei titoli

I Certificati costituiscono obbligazioni dirette, non subordinate e non garantite dell'Emittente e, salvo diversamente previsto dalla legge, non sussistono clausole di postergazione tra i Titoli stessi, e (salvo in relazione a certe obbligazioni la cui preferenza è imposta dalla legge) avranno pari grado rispetto a tutte le altre obbligazioni non garantite (diverse dalle obbligazioni non subordinate, ove presenti) dell'Emittente, di volta in volta in essere.

Restrizioni alla libera negoziabilità dei titoli

I Titoli saranno liberamente trasferibili, fatte salve le restrizioni sull'offerta e la vendita previste negli Stati Uniti, nello Spazio Economico Europeo ai sensi del Regolamento Prospetto e delle leggi di qualsiasi giurisdizione in cui i relativi Titoli sono offerti o venduti.

Dove saranno negoziati i titoli?

Sarà presentata richiesta di ammissione dei Titoli alla negoziazione sul mercato regolamentato di *Euronext Dublin* con effetto a partire dalla Data di Emissione o da una data intorno alla Data di Emissione.

Sarà altresì presentata richiesta di ammissione dei Titoli alla negoziazione presso il sistema multilaterale di negoziazione SeDeX, organizzato e gestito

da Borsa Italiana S.p.A., che non è un mercato regolamentato ai sensi della Direttiva 2014/65/UE come modificata, con effetto a partire dalla Data di Emissione o da una data intorno alla Data di Emissione.

Successivamente alla Data di Emissione, potrà essere presentata richiesta di quotazione dei Titoli su altre borse valori o mercati regolamentati, o di ammissione alla negoziazione su altre sedi di negoziazione, a scelta dell'Emittente.

Quali sono i principali rischi specifici dei titoli?

I Certificati possono non essere un investimento adatto a tutti gli investitori

I Titoli sono strumenti finanziari complessi. Un potenziale investitore non dovrebbe investire in Titoli che sono strumenti finanziari complessi senza possedere l'esperienza (da solo o con l'aiuto di un consulente finanziario) per valutare quale sia l'andamento dei Titoli in condizioni mutevoli, gli effetti che si producono sul valore dei Titoli e l'impatto che tale investimento avrà sul portafoglio complessivo dell'investitore.

Rischi generali e rischi relativi all'Attività Sottostante

I Titoli comportano un alto grado di rischio che può includere, tra le altre cose, i rischi relativi al tasso d'interesse, al tasso di cambio, al valore nel tempo e alla situazione politica. Gli acquirenti devono essere pronti a sostenere una perdita parziale o totale del prezzo di acquisto dei loro Titoli. Le variazioni del valore della relativa Attività Sottostante incideranno sul valore dei Titoli. Gli acquirenti corrono il rischio di perdere l'intero investimento o parte di esso se il valore della relativa Attività Sottostante non dovesse muoversi nella direzione prevista.

Alcune considerazioni relative ai Titoli legati ad Azioni

In caso di Titoli legati a un'azione o a GDRs/ADRs (o un paniere di azioni o un paniere di GDRs/ADRs), nessun emittente di tali azioni parteciperà alla redazione delle relative Condizioni Definitive o stabilirà le condizioni dei Titoli e né l'Emittente né i Collocatori effettueranno alcuna indagine in relazione a tale offerta riguardo a qualsiasi informazione relativa a tale emittente di azioni contenuta nelle Condizioni Definitive o nei documenti da cui tali informazioni sono estratte. Di conseguenza, non vi è alcuna garanzia che tutti gli eventi verificatisi prima della relativa data di emissione che potrebbero influenzare il prezzo delle azioni siano stati resi pubblici. Un'informativa successiva o una mancata informativa in merito a tali eventi o a eventi futuri che riguardano l'emittente di tali azioni potrebbe influenzare negativamente il prezzo di negoziazione delle azioni e, di conseguenza, il prezzo di negoziazione dei Titoli. I Portatori non avranno diritti di voto o diritto di ricevere dividendi o distribuzioni o qualsiasi altro diritto relativo alle azioni cui tali Titoli sono legati.

Rischio di perdita in relazione all'investimento

L'investitore deve considerare che sussiste un rischio di perdita totale o parziale del capitale investito che dipende dall'andamento dell'Attività Sottostante. In particolare, qualora si verifichi l'Evento Barriera, si verificherà una perdita del capitale investito. Se il Valore di Riferimento Finale dell'Attività Sottostante è pari a zero, l'investitore subirà una perdita totale del capitale investito. Inoltre, se prima dell'esercizio l'investitore decide di interrompere l'investimento nei Certificati, l'investitore potrebbe subire la perdita del valore del Certificato e, pertanto, potrebbe subire la perdita totale o parziale del capitale investito.

Rischio relativo al Livello Digital

L'Emittente, nella sua discrezionalità, ha fissato, in relazione ai *Certificates*, il Livello Digital. Più elevato è fissato il Livello Digital rispetto al Valore di Riferimento Iniziale, maggiore è la possibilità che non si verifichi l'Evento Digital e quindi che non venga corrisposto il relativo Importo Digital.

Impatto delle commissioni implicite sul Prezzo di Emissione/Prezzo di Offerta

Gli investitori devono notare che le commissioni implicite (e.g. commissioni di collocamento/commissioni di distribuzione, costi connessi alla strutturazione) potranno essere una componente del Prezzo di Emissione/Prezzo di Offerta dei Titoli, ma tali commissioni non verranno prese in considerazione ai fini di determinare il prezzo dei relativi Titoli nel mercato secondario. Gli investitori devono inoltre considerare che se i Titoli sono venduti sul mercato secondario immediatamente dopo il periodo di offerta relativo a tali Titoli, le commissioni implicite incluse nel Prezzo di Emissione/Prezzo di Offerta alla sottoscrizione iniziale di tali Titoli saranno dedotte dal prezzo al quale tali Titoli possono essere venduti sul mercato secondario.

Possibile illiquidità dei Titoli sul mercato secondario

Non è possibile prevedere il prezzo al quale i Titoli saranno scambiati sul mercato secondario o se tale mercato sarà liquido o illiquido. L'Emittente, o qualsiasi altra sua Società Affiliata, in qualsiasi momento, potrà, ma non sarà obbligato a, acquistare i Titoli a qualsiasi prezzo sul mercato o mediante offerta o trattativa privata. Qualsiasi Titolo così acquistato potrà essere detenuto o rivenduto o restituito per la cancellazione. L'Emittente, o qualsiasi altra sua Società Affiliata potrà, ma non sarà obbligato ad essere un market maker per l'emissione di Titoli. Anche se l'Emittente o tale altro soggetto è un market maker per l'emissione di Titoli, il mercato secondario di tali Titoli può essere limitato. Nella misura in cui un'emissione di Titoli diventi illiquida, un investitore potrebbe dover aspettare fino alla Data di Esercizio per ottenerne il valore.

Sezione 4 – Informazioni fondamentali sull'offerta pubblica di titoli

A quali condizioni posso investire in questo titolo e qual è il calendario previsto?

Termini generali, condizioni e calendario previsto dell'offerta

Giurisdizione/i dell'Offerta Pubblica: Repubblica Italiana

Numero massimo di Titoli offerti: 130.000¹⁴

Prezzo di Offerta: Euro 1.000.

Periodo di Offerta: dal 26 giugno 2024 sino al 25 luglio 2024 incluso o, limitatamente all'Offerta effettuata per il tramite di consulenti finanziari abilitati all'offerta fuori sede, sino al 18 luglio 2024 incluso o, limitatamente all'Offerta mediante tecniche di comunicazione a distanza, sino all'11 luglio 2024 incluso (il "Periodo di Offerta").

Condizioni a cui l'offerta è soggetta: L'Offerta dei Titoli è subordinata alla loro emissione e al rilascio, prima della Data di Emissione, da parte di Borsa Italiana S.p.A., o altra piattaforma di negoziazione, dell'autorizzazione relativa all'ammissione a negoziazione dei Titoli.

Termini dell'Offerta: I Titoli sono offerti tramite un'Offerta Non Esente in Italia ai sensi degli articoli 24 e 25 del Regolamento Prospetto. I Titoli saranno distribuiti tramite un'offerta pubblica e le attività di distribuzione saranno svolte dal Distributore.

L'Emittente si riserva il diritto, a sua esclusiva discrezione, di chiudere l'offerta anticipatamente, anche nel caso in cui le sottoscrizioni dei Titoli non

¹⁴ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

raggiungano l'importo massimo di 130.000¹⁵ Titoli. La chiusura anticipata del Periodo di Offerta dovrà essere comunicata dall'Emittente tramite pubblicazione di un avviso sul sito web dell'Emittente. Gli effetti della chiusura anticipata dell'offerta decorrono a partire dalla data indicata in tale avviso. L'Emittente si riserva il diritto di prorogare la chiusura dell'Offerta, al fine di estendere il Periodo di Offerta. La proroga del Periodo di Offerta sarà comunicata dall'Emittente tramite avviso da pubblicarsi sul sito web dell'Emittente. L'Emittente si riserva la facoltà di aumentare, durante il Periodo di Offerta, il numero massimo di Titoli offerti. L'Emittente darà immediatamente avviso di tale aumento mediante pubblicazione di un avviso sul sito web dell'Emittente. L'Emittente si riserva il diritto, a sua esclusiva discrezione, di revocare o ritirare l'offerta e l'emissione dei Titoli in qualsiasi momento prima della Data di Emissione. La revoca o il ritiro dell'offerta dovranno essere comunicati tramite pubblicazione sul sito web dell'Emittente. La revoca/il ritiro dell'offerta avranno effetto dal momento di tale pubblicazione. All'atto della revoca o del ritiro dell'offerta tutte le domande di sottoscrizione diverranno nulle ed inefficaci, senza ulteriore preavviso.

Ammontare minimo e massimo di sottoscrizione: I Titoli possono essere sottoscritti in un lotto minimo di un (1) Certificato e in un numero intero di Titoli superiore a tale ammontare e che sia un multiplo integrale di 1. Non vi è un limite massimo di richieste entro il numero massimo di Titoli offerti (130.000¹⁶).

Spese addebitate all'investitore dall'emittente o dall'offerente

Il Prezzo di Offerta è comprensivo di:

- commissioni di distribuzione pari al 2,00 per cento del Prezzo di Emissione in relazione alla totalità dei Titoli distribuiti; e
- oneri relativi alla gestione del rischio per il mantenimento delle condizioni dell'Offerta pari allo 0,762 per cento del Prezzo di Emissione.

Chi è l'offerente?

L'Emittente Intesa Sanpaolo S.p.A., con sede legale in Piazza San Carlo, 156 – 10121 Torino, Italia, agirà quale distributore dei Titoli (il "**Distributore**").

L'Emittente agirà altresì in veste di Responsabile del Collocamento ai sensi dell'art. 93-*bis* del D. Lgs. 24 febbraio 1998 n. 58 come successivamente modificato.

Ragioni dell'offerta e proventi netti stimati

L'Emittente intende utilizzare i proventi netti di ciascuna emissione di Certificati per finalità generali societarie, inclusa la realizzazione di profitti. Una parte sostanziale dei proventi può essere utilizzata per la copertura dei rischi di mercato relativi ai Certificati.

I proventi netti (risultanti dalla sottrazione delle commissioni e dei costi di cui sopra, dal Prezzo di Emissione complessivamente pagato dai Portatori) dell'emissione dei Titoli saranno fino a Euro 126.409.400¹⁷.

Indicazione se l'offerta è soggetta a un accordo di sottoscrizione con assunzione a fermo

Non applicabile

Indicazione dei conflitti di interesse più significativi che riguardano l'offerta o l'ammissione alla negoziazione

Intesa Sanpaolo S.p.A., l'Emittente dei Titoli, agirà altresì in veste di Distributore, pertanto questo comporta un conflitto di interessi.

L'Emittente potrà stipulare accordi di copertura con controparti di mercato in relazione all'emissione dei Titoli ai fini di copertura della propria esposizione finanziaria.

L'Emittente agirà come Agente di Calcolo ai sensi dei Titoli.

Inoltre, l'Emittente potrà agire come *liquidity provider* (come definito ai sensi delle regole del mercato di riferimento, come di volta in volta modificate) in relazione ai Titoli.

Salvo quanto sopra indicato, ed eccezion fatta per le commissioni e i costi di cui sopra, per quanto a conoscenza dell'Emittente, nessun soggetto coinvolto nell'emissione dei Titoli ha un interesse sostanziale in relazione all'Offerta.

¹⁵ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

¹⁶ Come modificato da "120.000" a "130.000" in data 10 luglio 2024.

¹⁷ Come modificato da "116.685.600" a "126.409.400" in data 10 luglio 2024.