

Milano, 14 gennaio 2021

## **AVVISO DI RETTIFICA DELLE CARATTERISTICHE DEI CERTIFICATI BANCO BPM SU FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES**

La società Banco BPM S.p.A (di seguito "**Banco BPM**"), con sede legale in Piazza Filippo Meda n. 4 - Milano e sede amministrativa in Piazza Nogara n. 2 - Verona, con riferimento ai Certificati "Equity Protection Certificates con Cap e Cedola" su Basket di Azioni Protezione 95% Cedola 2,80% – 29.09.2023 con ISIN IT0005421109 (di seguito "**Certificati**")

### **PREMESSO**

Che il 13 gennaio 2021 la società Fiat Chrysler Automobiles ha annunciato che il prossimo 29 gennaio sarà pagato un dividendo straordinario di 1,84 Eur per azione ordinaria FCA ai titolari legittimati entro la chiusura delle contrattazioni di venerdì 15 gennaio 2021 (Avviso di Borsa n.364 del 05 gennaio 2021 e Avviso di Borsa n.1085 del 13 gennaio 2021).

### **COMUNICA**

Che, con efficacia dal 14 gennaio 2021, le caratteristiche dei Certificati, tra i cui componenti del Basket risulta l'azione Fiat Chrysler Automobiles, emessi da Banco BPM e quotati sul mercato EuroTLX di Borsa Italiana, vengono modificati secondo le modalità previste dal mercato IDEM (Avviso di Borsa n.892 del 12 gennaio 2021).

Il mercato IDEM di Borsa Italiana S.p.A. ha determinato, alla chiusura delle negoziazioni del 13 gennaio 2021, il coefficiente K di rettifica dei contratti di opzione sull'azione Fiat Chrysler Automobiles pari a 0,874076 (Avviso di Borsa n.1165 del 13 gennaio 2021).

Di conseguenza, ai sensi dell'art. 5.18 "Regole di adeguamento applicabili in caso di fatti aventi un'incidenza sul sottostante" della Nota Informativa relativa al programma Certificati a Capitale Parzialmente o Totalmente Protetto di Banco BPM, utilizzando tale fattore K vengono adeguati il Valore Iniziale, il Livello di Protezione, il Livello Cap, il Livello di Soglia Cedola e i Pesi Assoluti relativi ai Certificati.

In particolare, i nuovi valori vengono calcolati applicando al componente del Basket Fiat Chrysler Automobiles il prodotto del vecchio Valore Iniziale del titolo per K, come riepilogato di seguito:

Sottostante	ISIN Sottostante	Ticker Bloomberg	Peso Percentuale	Vecchio Valore Iniziale	Valore Iniziale Rettificato	Vecchio Peso Assoluto	Peso Assoluto Rettificato
A2A SPA	IT0001233417	A2A IM Equity	12,50%	1,240	1,240	0,8490171371	<b>0,8324067540</b>
<b>FIAT CHRYSLER AM</b>	NL0010877643	FCA IM Equity	12,50%	10,468	<b>9,1498</b>	0,1005713842	<b>0,1128095013</b>
CNH INDUSTRIAL	NL0010545661	CNHI IM Equity	12,50%	6,648	6,648	0,1583605972	<b>0,1552623909</b>
POSTE ITALIANE AOR	IT0003796171	PST IM Equity	12,50%	7,568	7,568	0,1391095732	<b>0,1363879988</b>
MONCLER SPA	IT0004965148	MN IM Equity	12,50%	34,980	34,980	0,0300966624	<b>0,0295078438</b>
ARNOLDO MONDADORI EDITORE SPA	IT0001469383	MONC IM Equity	12,50%	1,132	1,132	0,9300187721	<b>0,9118236528</b>
TELECOM ITALIA SPA	IT0003497168	TIT IM Equity	12,50%	0,342	0,342	3,0783077485	<b>3,0180829678</b>
LEONARDO-FINMECCANICA	IT0003856405	LDO IM Equity	12,50%	5,000	5,000	0,2105562500	<b>0,2064368750</b>

Basket	Vecchio Valore Iniziale	Valore Iniziale Rettificato	Vecchio Livello di Protezione	Livello di Protezione Rettificato	Vecchio Livello Cap	Livello Cap Rettificato	Vecchio Livello di Soglia Cedola	Livello di Soglia Cedola Rettificato
Basket di Azioni (A2A, <b>FIAT CHRYSLER</b> , CNH INDUSTRIAL, POSTE ITALIANE, MONCLER, ARNOLDO MONDADORI EDITORE, TELECOM ITALIA, LEONARDO-FINMECCANICA)	8,422	<b>8,257</b>	8,001	<b>7,845</b>	8,422	<b>8,257</b>	i=1,2,3 8,422	i=1,2,3 <b>8,257</b>