

Milano, 15 marzo 2021

AVVISO DI RETTIFICA DELLE CARATTERISTICHE DEI CERTIFICATI BANCO BPM SU STELLANTIS

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 12 marzo 2021 la società Stellantis ha annunciato che il prossimo 22 marzo sarà pagato un dividendo straordinario di 0,096677 Eur per azione ordinaria STLA ai titolari legittimati entro la chiusura delle contrattazioni di martedì 16 marzo 2021 (Avviso di Borsa n.6673 del 05 marzo 2021 e Avviso di Borsa n.7163 del 10 marzo 2021).

COMUNICA

Che, con efficacia dal 15 marzo 2021, le caratteristiche dei Certificati, tra i cui componenti del Basket risulta l'azione Stellantis, 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.6879 del 08 marzo 2021).

Il mercato IDEM di Borsa Italiana S.p.A. ha determinato, alla chiusura delle negoziazioni del 12 marzo 2021, il coefficiente K di rettifica dei contratti di opzione sull'azione Stellantis pari a 0,942427 (Avviso di Borsa n.7686 del 12 marzo 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 Stellantis 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	0,8324067540	0,8257686492
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	STLA IM Equity	12,50%	10,468	8,623	0,1128095013	0,1187467384
CNH INDUSTRIAL	NL0010545661	CNHI IM Equity	12,50%	6,648	6,648	0,1552623909	0,1540242366
POSTE ITALIANE AOR	IT0003796171	PST IM Equity	12,50%	7,568	7,568	0,1363879988	0,1353003601
MONCLER SPA	IT0004965148	MN IM Equity	12,50%	34,980	34,980	0,0295078438	0,0292725307
ARNOLDO MONDADORI EDITORE SPA	IT0001469383	MONC IM Equity	12,50%	1,132	1,132	0,9118236528	0,9045522306
TELECOM ITALIA SPA	IT0003497168	TIT IM Equity	12,50%	0,342	0,342	3,0180829678	2,9940149854
LEONARDO-FINMECCANICA	IT0003856405	LDO IM Equity	12,50%	5,000	5,000	0,2064368750	0,2047906250

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, STELLANTIS , CNH INDUSTRIAL, POSTE ITALIANE, MONCLER, ARNOLDO MONDADORI EDITORE, TELECOM ITALIA, LEONARDO-FINMECCANICA)	8,257	8,192	7,845	7,782	8,257	8,192	i=1,2,3 8,257	i=1,2,3 8,192