

Informazione Regolamentata n. 0035-103-2015	Data/Ora Ricezione 29 Giugno 2015 14:17:53	MTA
---	--	-----

Societa' : BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA
Identificativo : 60251
Informazione
Regolamentata
Nome utilizzatore : PASCHIN04 - Avv. Lombardi
Tipologia : AVVI 16
Data/Ora Ricezione : 29 Giugno 2015 14:17:53
Data/Ora Inizio : 29 Giugno 2015 14:32:53
Diffusione presunta
Oggetto : Covered Warrant BMPS - Cap. Euribor 3M

Testo del comunicato

Vedi allegato.



**MONTE
DEI PASCHI
DI SIENA**
BANCA DAL 1472

Siena, 29 giugno 2015

Covered Warrant Banca Monte dei Paschi di Siena Cap Euribor3M - Strike 5%

Determinazione del "Differenziale" da riconoscere ai portatori di Covered Warrant Banca Monte dei Paschi di Siena.

Si comunica che Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A., ai sensi del paragrafo §4 (1) del Regolamento, in data **29 giugno 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 luglio – 30 settembre 2015** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,016**
(Livello di Riferimento)

Ai sensi del paragrafo §3 (1) del Regolamento, essendo il risultato della seguente formula:

Nominale x (Livello di Riferimento – Strike) x Coefficiente di Periodo

nel caso specifico:

$$5.000 \times (-0,016 - 5,000) \times 92/36.000$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 settembre 2015** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire alcun "Differenziale".

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A



**MONTE
DEI PASCHI
DI SIENA**
BANCA DAL 1472

Siena, 29 giugno 2015

Covered Warrant Banca Monte dei Paschi di Siena Cap Euribor3M - Strike 4%

Determinazione del "Differenziale" da riconoscere ai portatori di Covered Warrant Banca Monte dei Paschi di Siena.

Si comunica che Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A., ai sensi del paragrafo §4 (1) del Regolamento, in data **29 giugno 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 luglio – 30 settembre 2015** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,016** (Livello di Riferimento)

Ai sensi del paragrafo §3 (1) del Regolamento, essendo il risultato della seguente formula:

Nominale x (Livello di Riferimento – Strike) x Coefficiente di Periodo

nel caso specifico:

5.000 x (-0,016 – 4,000) x 92/36.000

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 settembre 2015** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A



**MONTE
DEI PASCHI
DI SIENA**
BANCA DAL 1472

Siena, 29 giugno 2015

Covered Warrant Monte dei Paschi di Siena Cap Spread Euribor3M - Strike 3,5%

Determinazione del "Differenziale" da riconoscere ai portatori di Covered Warrant Banca Monte dei Paschi di Siena.

Si comunica che Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A., ai sensi del paragrafo §4 (1) del Regolamento, in data **29 giugno 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 luglio – 30 settembre 2015** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,016**
(Livello di Riferimento)

Ai sensi del paragrafo §3 (1) del Regolamento, essendo il risultato della seguente formula:

$$\text{Max [0; VN x CP x Y x (1/Cambio di Rif)]}$$

Dove

VN = Valore Nominale

CP = Coef. di Periodo (numero giorni del Periodo di riferimento diviso 36.000)

1/Cambio di Rif= 1

Y = Min [S; Livello di riferimento - Strike]

S = 2

Strike= 3,50

Livello di riferimento= Euribor 3M dei 2 gg lavorativi prec inizio Periodo di Rif
nel caso specifico:

$$\text{Max [0; 5.000 x 92/36.000 x Min (2; -0,016 – 3,500)]}$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 settembre 2015** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.



**MONTE
DEI PASCHI
DI SIENA**
BANCA DAL 1472

Siena, 29 giugno 2015

Covered Warrant Banca Monte dei Paschi di Siena Cap Euribor3M - Strike 3%

Determinazione del "Differenziale" da riconoscere ai portatori di Covered Warrant Banca Monte dei Paschi di Siena.

Si comunica che Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A., ai sensi del paragrafo §4 (1) del Regolamento, in data **29 giugno 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 luglio – 30 settembre 2015** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,016**
(Livello di Riferimento)

Ai sensi del paragrafo §3 (1) del Regolamento, essendo il risultato della seguente formula:

Nominale x (Livello di Riferimento – Strike) x Coefficiente di Periodo

nel caso specifico:

$$5.000 \times (-0,016 - 3,000) \times 92/36.000$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 settembre 2015** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.

Fine Comunicato n.0035-103

Numero di Pagine: 6