

# Bit Market Services

Informazione Regolamentata n. 0035-142-2015	Data/Ora Ricezione 30 Dicembre 2015 14:37:17	MTA
---	--	-----

Societa' : BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA

Identificativo : 67530

Informazione

Regolamentata

Nome utilizzatore : PASCHIN04 - Avv. Lombardi

Tipologia : AVVI 16

Data/Ora Ricezione : 30 Dicembre 2015 14:37:17

Data/Ora Inizio : 30 Dicembre 2015 14:52:18

Diffusione presunta

Oggetto : Covered Warrant BMPS

*Testo del comunicato*

Vedi allegato.



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

Siena, 30 dicembre 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 **30 dicembre 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 gennaio – 31 marzo 2016** (giorni periodo **91**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,132**  
(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 (-0,132 – 3,000) x 91/36.000**

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **31 marzo 2016** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

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

Siena, 30 dicembre 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 **30 dicembre 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 gennaio – 31 marzo 2016** (giorni periodo **91**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,132**  
(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

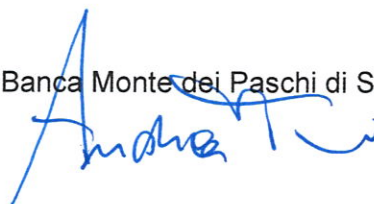
Strike= 3,50

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

$$\text{Max [ 0; 5.000 x 91/36.000 x Min ( 2; -0,132 - 3,500)]}$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **31 marzo 2016** 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, 30 dicembre 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 **30 dicembre 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 gennaio – 31 marzo 2016** (giorni periodo **91**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,132** (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 (-0,132 – 4,000) x 91/36.000**

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **31 marzo 2016** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A



Siena, 30 dicembre 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 **30 dicembre 2015** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 gennaio – 31 marzo 2016** (giorni periodo **91**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,132**  
(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 (-0,132 – 5,000) x 91/36.000**

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **31 marzo 2016** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire alcun "Differenziale".

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



Fine Comunicato n.0035-142

Numero di Pagine: 6