

Bit Market Services

Informazione Regolamentata n. 0035-44-2016	Data/Ora Ricezione 29 Giugno 2016 15:07:22	MTA
--	--	-----

Societa' : BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA

Identificativo : 76275

Informazione

Regolamentata

Nome utilizzatore : PASCHIN02 - Avv. Lombardi

Tipologia : AVVI 16

Data/Ora Ricezione : 29 Giugno 2016 15:07:22

Data/Ora Inizio : 29 Giugno 2016 15:22:23

Diffusione presunta

Oggetto : Covered Warrant BMPS

Testo del comunicato

Vedi allegato.

Siena, 29 giugno 2016

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 2016** (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 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,282**
(Livello di Riferimento)

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

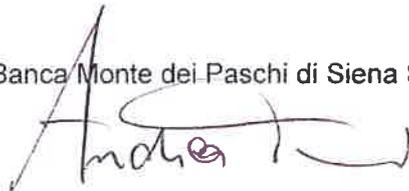
Nominale x (Livello di Riferimento – Strike) x Coefficiente di Periodo

nel caso specifico:

$$5.000 \times (-0,282 - 3,000) \times 92/36.000$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 settembre 2016** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

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



Siena, 29 giugno 2016

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 2016** (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 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,282**
(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

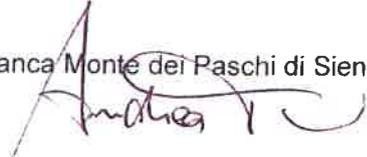
Strike= 3,50

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

$$\text{Max [0; 5.000 x 92/36.000 x Min (2; -0,282 – 3,500)]}$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 settembre 2016** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

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



Siena, 29 giugno 2016

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 2016** (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 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,282** (Livello di Riferimento)

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

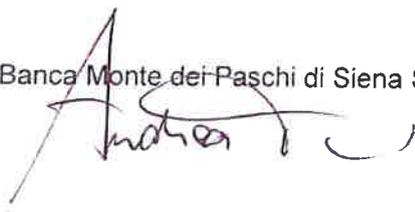
Nominale x (Livello di Riferimento – Strike) x Coefficiente di Periodo

nel caso specifico:

5.000 x (-0,282 – 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 2016** i portatori dei Warrant **non avranno diritto** a percepire il "Differenziale".

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A



Siena, 29 giugno 2016

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 2016** (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 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M -0,282
(Livello di Riferimento)

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

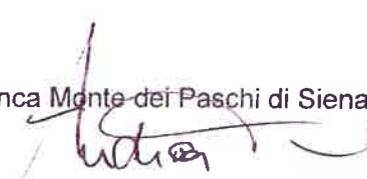
Nominale x (Livello di Riferimento – Strike) x Coefficiente di Periodo

nel caso specifico:

$$5.000 \times (-0,282 - 5,000) \times 92/36.000$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 settembre 2016** i portatori dei Warrant **non avranno diritto a percepire alcun "Differenziale"**.

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A



Fine Comunicato n.0035-44

Numero di Pagine: 6