

# Bit Market Services

Informazione Regolamentata n. 0035-83-2016	Data/Ora Ricezione 29 Settembre 2016 16:00:29	MTA
--	---	-----

Societa' : BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA  
Identificativo : 79565  
Informazione  
Regolamentata  
Nome utilizzatore : PASCHIN04 - Avv. Lombardi  
Tipologia : AVVI 16  
Data/Ora Ricezione : 29 Settembre 2016 16:00:29  
Data/Ora Inizio : 29 Settembre 2016 16:15:31  
Diffusione presunta  
Oggetto : Covered Warrant BMPS: 1° ottobre - 31  
dicembre 2016

*Testo del comunicato*

Vedi allegato.

Siena, 29 settembre 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 settembre 2016** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 ottobre – 31 dicembre 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,301**  
(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

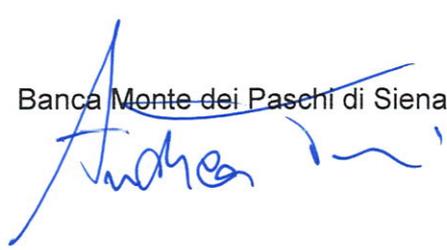
Strike= 3,50

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

$$\text{Max [ 0; 5.000 x 92/36.000 x Min ( 2; -0,301 - 3,500)]}$$

essendo il risultato della suddetta formula **inferiore a zero**, alla data di esercizio (Data di Pagamento) del **30 dicembre 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, 29 settembre 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 settembre 2016** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 ottobre – 31 dicembre 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,301**  
(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 (-0,301 – 5,000) x 92/36.000**

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

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

Siena, 29 settembre 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 settembre 2016** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 ottobre – 31 dicembre 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,301** (Livello di Riferimento)

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

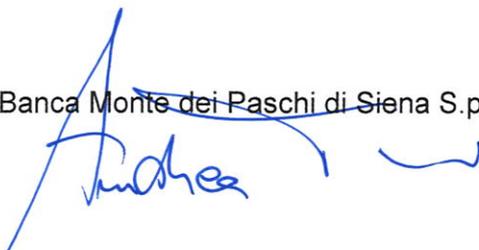
**Nominale x (Livello di Riferimento – Strike) x Coefficiente di Periodo**

nel caso specifico:

**5.000 x (-0,301 – 4,000) x 92/36.000**

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

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



Siena, 29 settembre 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 settembre 2016** (Giorno di Rilievo) alle **ore 11,00** (fonte Reuter pag. EURIBOR01), secondo giorno lavorativo bancario antecedente l'inizio del "Periodo di Riferimento" **1 ottobre – 31 dicembre 2016** (giorni periodo **92**), ha rilevato il seguente dato:

Euribor 3M **-0,301**  
(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 (-0,301 – 3,000) x 92/36.000**

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

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



Fine Comunicato n.0035-83

Numero di Pagine: 6