

FINAL TERMS

11 October 2024

Intesa Sanpaolo S.p.A.

Legal entity identifier (LEI): 2W8N8UU78PMDQKZENC08

130 Series of CALL COVERED WARRANTS on Shares due 03.03.2025 and 02.06.2025

"Intesa Sanpaolo S.p.A. Covered Warrants su Azioni di tipo Call Scadenza 03.03.2025 e 02.06.2025"

under the Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking

PART A – CONTRACTUAL TERMS

Terms used herein shall be deemed to be defined as such for the purposes of the Terms and Conditions set forth in the Base Prospectus dated 12 June 2024 and the supplement to the Base Prospectus dated 2 August 2024, which together constitute a base prospectus for the purposes of the Prospectus Regulation as amended. This document constitutes the Final Terms of the Securities described herein for the purposes of Article 8(1) of the Prospectus Regulation and must be read in conjunction with the Base Prospectus, as supplemented. Full information on the Issuer and the offer of the Securities is only available on the basis of the combination of these Final Terms and the Base Prospectus, as supplemented. The Base Prospectus and the supplement to the Base Prospectus are available for viewing during normal business hours at the registered office of the Issuer. The Base Prospectus and the supplement to the Base Prospectus have been published on the websites of the Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com) and the Issuer (www.prodottiequotazioni.intesasanpaolo.com). An issue specific summary of the Securities is annexed to these Final Terms. In the case of the Securities admitted to trading on the regulated market of the Luxembourg Stock Exchange, the Final Terms will be published on the website of the Luxembourg Stock Exchange and of the Issuer.

References herein to numbered Conditions are to the terms and conditions of the relevant series of Securities and words and expressions defined in such terms and conditions shall bear the same meaning in these Final Terms insofar as they relate to such series of Securities, save as where otherwise expressly provided.

These Final Terms relate to the series of Securities as set out in "Specific Provisions for each Series" below. References herein to "Securities" shall be deemed to be references to the relevant Warrants that are the subject of these Final Terms and references to "Securities" and "Security" shall be construed accordingly.

1. Specific provisions for each Series:

| Series Number | No. of Securities issued | Indicative Price per Security |
|----------------------|--|---|
| 217 to 346 | The number of Securities issued is specified per each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below. | The Indicative Price of each Series of Covered Warrants determined on the basis of the market parameters on 3 October 2024 is equal to the amount specified per each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below. |

2. Tranche Number: Not applicable
3. Minimum Exercise Number: The Minimum Exercise Number is set out in relation to each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below.
4. Minimum Trading Number: The Minimum Trading Number is set out in relation to each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary"

| | | |
|-----|--|---|
| | | below. |
| 5. | Consolidation: | Not applicable |
| 6. | Type of Securities and Underlying(s): | (a) The Securities are Covered Warrants. The Warrants are European Style Warrants. (b) The items to which the Securities relate are the shares set out in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below (the " Shares " or the " Underlying "). |
| 7. | Reference Underlying: | Not applicable |
| 8. | Typology: | Call Covered Warrants |
| 9. | (i) Exercise Date: | The Exercise Date of the Securities is set out in relation to each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below. |
| | (ii) Renunciation Notice Cut-off Time: | Equal to the relevant Valuation Date. |
| 10. | Settlement Date: | The Settlement Date for the Securities falls two Business Days following the relevant Exercise Date. If, on the relevant Valuation Date a Market Disruption Event occurs, the relevant Settlement Date will be postponed accordingly. Such Settlement Date shall not, in any case, be postponed beyond the tenth Business Day following the relevant Valuation Date. |
| 11. | Delivery Date: | Not applicable. |
| 12. | Issue Date: | The Issue Date is 9 October 2024. |
| 13. | Issue Currency: | The Issue Currency is Euro (" EUR "). |
| 14. | Purchase Price: | Not applicable |
| 15. | Business Day: | Not applicable |
| 16. | Exchange Business Day: | Not applicable |
| 17. | Settlement Business Day: | Not applicable |
| 18. | Settlement: | Settlement will be by way of cash payment (" Cash Settled Securities "). |
| 19. | Exchange Rate: | Not applicable |
| 20. | Settlement Currency: | The Settlement Currency for the payment of the Cash Settlement Amount is EUR. |
| 21. | Name and address of Calculation Agent: | The Calculation Agent is Intesa Sanpaolo S.p.A., with registered office at Piazza San Carlo, 156 10121 Turin, Italy. |
| 22. | Exchange(s): | The relevant Exchange is set out in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below. |

| | | |
|-----|--|---|
| 23. | Reference Source: | The Reference Source is, in relation to each Series, the relevant Exchange. |
| 24. | Related Exchange(s): | <p>The relevant Related Exchange is:</p> <ul style="list-style-type: none"> – Euronext Derivatives Milan of Borsa Italiana S.p.A., in relation to the Series that specify Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. as Exchange in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below; – EUREX, in relation to the Series that specify Euronext Paris as Exchange in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below; – EUREX, in relation to the Series that specify XETRA as Exchange in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below. |
| 25. | Futures Contract N-th Near-by Feature: | Not applicable |
| 26. | Open End Feature: | Not applicable |
| 27. | Put Option: | Not applicable |
| 28. | Call Option: | Not applicable |
| 29. | Maximum Level: | Not applicable |
| 30. | Minimum Level: | Not applicable |
| 31. | Settlement Amount: | <p>On the Settlement Date each Covered Warrant will entitle its holder to receive a Cash Settlement Amount in the Settlement Currency calculated by the Calculation Agent in accordance with the following formula and rounding the resultant figure to nearest EUR cent, 0.005 EUR being rounded upwards:</p> $\text{Max } [0; (\text{Final Reference Value} - \text{Exercise Price})] \times \text{Multiplier} \times \text{Minimum Exercise Number}$ |
| 32. | Multiplier: | The Multiplier to be applied is set out in relation to each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below. |
| 33. | Relevant Asset(s): | Not applicable |
| 34. | Entitlement: | Not applicable |
| 35. | AMF: | Not applicable |
| 36. | VMF: | Not applicable |
| 37. | Index Leverage Factor: | Not applicable |
| 38. | Constant Leverage Factor: | Not applicable |
| 39. | Strike Price: | Not applicable |
| 40. | Conversion Rate: | Not applicable |

| | | |
|-----|--|--|
| 41. | Underlying Reference Currency: | The Underlying Reference Currency is EUR |
| 42. | Quanto Option: | Not applicable |
| 43. | Determination Date(s): | Not applicable |
| 44. | Valuation Date(s): | The Valuation Date falls on the Business Day prior to the relevant Exercise Date. |
| 45. | Intraday Value: | Not applicable |
| 46. | Reference Value: | Not applicable |
| 47. | Initial Reference Value: | Not applicable |
| | Initial Reference Value Determination Period(s): | Not applicable |
| 48. | Final Reference Value: | The Final Reference Value, for the purpose of the calculation of the Cash Settlement Amount, will be registered on the relevant Valuation Date and will be an amount equal to: <ul style="list-style-type: none"> – the reference price of the relevant Share in relation to the Series that specify Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. as Exchange in the "Annex to the Final Terms and to the Summary"; – the closing price of the relevant Share in relation to the Series that do not specify Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. as Exchange in the "Annex to the Final Terms and to the Summary". |
| | Final Reference Value Determination Period(s): | Not applicable |
| 49. | Best Of Feature: | Not applicable |
| 50. | Worst Of Feature: | Not applicable |
| 51. | Rainbow Feature: | Not applicable |
| 52. | Reverse Split: | Not applicable |

PROVISIONS RELATING TO CERTIFICATES

Not applicable.

| | | |
|-----|-----------------------------------|----------------|
| 53. | Performance Cap: | Not applicable |
| | Performance Floor: | Not applicable |
| | Performance Participation Factor: | Not applicable |
| 54. | Initial Percentage: | Not applicable |
| 55. | Participation Factor: | Not applicable |
| 56. | Down Participation Factor: | Not applicable |

| | | |
|-----|--|----------------|
| 57. | Up Participation Factor: | Not applicable |
| 58. | Initial Leverage: | Not applicable |
| 59. | Barrier Event: | Not applicable |
| 60. | Barrier Gap Event: | Not applicable |
| 61. | Cap Level(s): | Not applicable |
| 62. | Floor Percentage: | Not applicable |
| 63. | Consolidation Floor Event | Not applicable |
| 64. | Cap Barrier Amount: | Not applicable |
| 65. | Cap Down Amount: | Not applicable |
| 66. | Strike Percentage: | Not applicable |
| 67. | Calendar Cap Percentage: | Not applicable |
| 68. | Calendar Floor Percentage: | Not applicable |
| 69. | Gearing Factor: | Not applicable |
| 70. | One Star Event: | Not applicable |
| 71. | Switch Event: | Not applicable |
| 72. | Multiple Strike Event; | Not applicable |
| 73. | Spread: | Not applicable |
| 74. | Gearing Event: | Not applicable |
| 75. | Buffer Event: | Not applicable |
| 76. | Global Performance: | Not applicable |
| 77. | Failure to Deliver due to Illiquidity: | Not applicable |
| 78. | Digital Percentage: | Not applicable |
| 79. | Settlement Level: | Not applicable |
| 80. | Combined Amount: | Not applicable |
| 81. | Darwin Feature: | Not applicable |

PROVISIONS RELATING TO REMUNERATION AMOUNTS AND EARLY REDEMPTION AMOUNTS

Not applicable

| | | |
|-----|--------------------|----------------|
| 82. | Knock-out Feature: | Not applicable |
|-----|--------------------|----------------|

| | | |
|-----|---------------------------------------|-----------------|
| 83. | Knock-in Feature: | Not applicable |
| 84. | Digital Amount(s): | Not applicable |
| 85. | Restrike Feature: | Not applicable |
| 86. | Plus Amount(s): | Not applicable |
| 87. | Accumulated Amount(s): | Not applicable |
| 88. | Early Redemption Amount(s): | Not applicable |
| 89. | Early Partial Capital Payment Amount: | Not applicable |
| 90. | Cumulated Bonus Amount: | Not applicable |
| 91. | Coupon Event: | Not applicable |
| 92. | Internal Return Amount: | Not applicable |
| 93. | Participation Remuneration Amount: | Not applicable |
| 94. | Participation Rebate Feature: | Not applicable |
| 95. | Floating Amount: | Not applicable |
| 96. | Premium Gap Amount: | Not applicable. |

PROVISIONS RELATING TO WARRANTS

Applicable

| | | |
|------|--|--|
| 97. | Type of Warrants: | (i) the Warrants are European Style Warrants (ii) the Warrants are Call Covered Warrants. |
| 98. | Notional Amount: | Not applicable |
| 99. | Day Count Fraction: | Not applicable |
| 100. | Exercise Price: | The Exercise Price of the Securities is set out in relation to each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below. |
| 101. | Premium: | The Premium is equal to the Indicative Price for each Covered Warrant. |
| 102. | Barrier Event: | Not applicable |
| | Barrier Event Determination Period(s): | Not applicable |
| | Barrier Valuation Period(s): | Not applicable |
| | Lower Barrier Level: | Not applicable |

| | | |
|------|----------------------------------|----------------|
| | Upper Barrier Level: | Not applicable |
| | Corridor Early Amount: | Not applicable |
| | Corridor Early Payment Date: | Not applicable |
| 103. | Strike Percentage: | Not applicable |
| 104. | Exercise Period: | Not applicable |
| 105. | Maximum Exercise Number: | Not applicable |
| 106. | Settlement Determination Period: | Not applicable |
| 107. | Settlement Determination Date: | Not applicable |

GENERAL

| | | |
|------|---|-----------------------------------|
| 108. | Form of Securities: | Italian Dematerialised Securities |
| 109. | Prohibition of Sales to Retail Investors: | Not applicable |

DISTRIBUTION

| | | |
|------|--------------|-----------------|
| 110. | Syndication: | Not applicable. |
|------|--------------|-----------------|

ADDITIONAL INFORMATION

| | |
|---|-----------------|
| Example(s) of complex derivatives securities: | Not applicable. |
|---|-----------------|

Signed on behalf of the Issuer:

By:
Duly authorised

PART B – OTHER INFORMATION

1. LISTING AND ADMISSION TO TRADING

- (i) Listing: None
- (ii) Admission to trading: Application has been made for the Securities to be admitted to trading on the Italian multilateral trading facility SeDeX, organised and managed by Borsa Italiana S.p.A., which is not a regulated market for the purposes of Directive 2014/65/EU as amended, with effect from the Issue Date or a date around the Issue Date.

After the Issue Date, application may be made to list the Securities on other stock exchanges or regulated markets or to admit to trading on other trading venues as the Issuer may decide.

2. NOTIFICATION

The CSSF has provided the *Commissione Nazionale per le Società e la Borsa* (CONSOB) with a certificate of approval attesting that the Base Prospectus has been drawn up in accordance with the Prospectus Regulation.

3. INTERESTS OF NATURAL AND LEGAL PERSONS INVOLVED IN THE ISSUE

The Issuer may enter into hedging arrangements with market counterparties in connection with the issue of the Securities in order to hedge its exposure.

The Issuer will act as Calculation Agent under the Securities. See the risk factor “Potential Conflicts of Interest” of the Base Prospectus.

In addition, the Issuer may act as liquidity provider (as defined under the rules of the relevant market, as amended from time to time) in respect of the Securities.

4. REASONS FOR THE OFFER, ESTIMATED NET PROCEEDS AND TOTAL EXPENSES

- (i) Reasons for the offer: Not applicable.
- (ii) Estimated net proceeds: Not applicable.
- (iii) Estimated total expenses: Not applicable.

5. TERMS AND CONDITIONS OF THE OFFER

Not applicable

6. DISTRIBUTION

- (i) Name(s) and address(es), to the extent known to the Issuer, of the Managers / Distributors in the various countries: None

where the offer takes place:

- (ii) Name and address of the co-ordinator(s) of the global offer and of single parts of the offer: Not applicable.
- (iii) Name and address of any paying agents and depository agents in each country (in addition to the Principal Security Agent): Not applicable.
- (iv) Entities agreeing to underwrite the issue on a firm commitment basis, and entities agreeing to place the issue without a firm commitment or under "best efforts" arrangements: Not applicable.
- (v) Date of signing of the placement agreement: Not applicable.

7. POST-ISSUANCE INFORMATION

The Issuer does not intend to provide post-issuance information except if required by any applicable laws and regulations.

8. OPERATIONAL INFORMATION

- (i) ISIN Code: In relation to each Series, the relevant ISIN Code is set out in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below.
- (ii) Trading Code (*codice di negoziazione*): In relation to each Series, the Trading Code (*codice di negoziazione*) is set out in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below.
- (iii) Any clearing system(s) other than Euroclear Bank S.A./N.V. and Clearstream Banking S.A., relevant address(es), and relevant identification number(s): Monte Titoli S.p.A.

PART C – ISSUE SPECIFIC SUMMARY OF THE SECURITIES

| |
|---|
| Section 1 – Introduction containing warnings |
| Securities: 130 Series of CALL COVERED WARRANTS on Shares due 03.03.2025 and 02.06.2025 (in relation to each Series of Warrants, the relevant ISIN Code is set out in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below). |
| Issuer: Intesa Sanpaolo S.p.A. (Intesa Sanpaolo , the Bank or the Issuer) Address: Piazza San Carlo 156, 10121 Turin, Italy Phone number: +39 011 555 1 Website: www.prodottiequotazioni.intesasanpaolo.com Legal Entity Identifier (LEI): 2W8N8UU78PMDQKZENC08 |
| Competent authority: <i>Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF)</i> , 283, route d'Arlon L-1150 Luxembourg. Phone number: (+352) 26 25 1 - 1. |
| Date of approval of the Base Prospectus: Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking approved by the CSSF on 12 June 2024. |
| This Summary should be read as an introduction to the Base Prospectus. Any decision to invest in the Securities should be based on consideration of the Base Prospectus as a whole by the investor. Investors could lose all or part of the invested capital. Where a claim relating to the information contained in the Base Prospectus is brought before a court, the plaintiff investor might, under the national legislation of the Member States, have to bear the costs of translating the Base Prospectus (including any supplements as well as the Final Terms) before the legal proceedings are initiated. Civil liability attaches only to those persons who have tabled the Summary including any translation thereof, but only if the Summary is misleading, inaccurate or inconsistent when read together with the other parts of the Base Prospectus, or it does not provide, when read together with the other parts of the Base Prospectus, all necessary key information in order to aid investors when considering whether to invest in the Securities. |
| You are about to purchase a product that is not simple and may be difficult to understand. |
| Section 2 – Key information on the Issuer |
| Who is the issuer of the securities? |
| The Issuer is Intesa Sanpaolo S.p.A., registered with the Companies' Registry of Turin under registration number 00799960158 and with the National Register of Banks under no. 5361 and is the parent company of "Gruppo Intesa Sanpaolo". Intesa Sanpaolo S.p.A. operates subject to the Banking Law. |
| Domicile and legal form, its LEI, the law under which it operates and its country of incorporation Intesa Sanpaolo's Legal Entity Identification number (LEI) is 2W8N8UU78PMDQKZENC08. The Issuer is an Italian bank established as a company limited by shares (<i>società per azioni</i>). The registered and administrative office of the Issuer is Piazza San Carlo 156, 10121 Turin, Italy. The Issuer is incorporated and carries out its business under Italian law. The Issuer, both as a bank and as is the parent company of "Gruppo Intesa Sanpaolo", is subject to the Bank of Italy's and European Central Bank's prudential supervision. |
| Principal activities The Issuer is a banking institution engaged in investment banking activities. The Issuer offers a wide range of capital markets, investment banking and special lending services to a diversified client base including banks, companies, institutional investors, entities and public bodies. The Issuer is the parent company of the "Gruppo Intesa Sanpaolo" which operates through six divisions: the Banca dei Territori division, the Corporate and Investment Banking division, the International Subsidiary Banks division, the Private Banking division, the Asset Management division and the Insurance division. |
| Major shareholders, including whether it is directly or indirectly owned or controlled and by whom As at 31 December 2023, the shareholder structure of the Issuer was composed as follows (holders of shares exceeding 3%): Fondazione Compagnia di San Paolo (ordinary shares: 1,188,947,304; owned: 6.503%); Fondazione Cariplo (ordinary shares: 961,333,900; owned: 5.258%). |
| Identity of its key managing directors |

The managing director of the Issuer is Carlo Messina (Chief Executive Officer).

Identity of its auditors

EY S.p.A., with registered office at Via Lombardia, 31 – 00187 Rome, was appointed by the Issuer as its independent auditor to audit its financial statements for the period 2021-2029.

What is the key financial information regarding the Issuer?

| Consolidated Income Statement | | | | | |
|--|----------------------------|---|---|---|---|
| | As for the year ended | | | As for the half year ended | |
| <i>EUR millions, except where indicated</i> | 31.12.23 <i>Audited</i> | 31.12.22 ¹ <i>Unaudited</i> | 31.12.22 ² <i>Audited</i> | 30.06.24 ³ <i>Unaudited</i> | 30.06.23 <i>Unaudited</i> |
| Interest margin | 16,936 | 11,835 | 9,685 | not available | not available |
| Net fee and commission income | 7,801 | 8,373 | 8,577 | not available | not available |
| Profits (Losses) on trading | 513 | 36 | (149) | not available | not available |
| Net losses/recoveries for credit risks | (1,416) | (2,636) | (2,624) | not available | not available |
| Net income from banking and insurance activities | 23,026 | 18,016 | 18,483 | not available | not available |
| Parent Company's net income (loss) | 7,724 | 4,379 | 4,354 | 4,766 | 4,222 |
| Consolidated Balance Sheet | | | | | |
| | As for the year ended | | | As for the half year ended | Value as outcome from the Supervisory Review and Evaluation Process ('SREP' requirement for 2024) |
| <i>EUR millions, except where indicated</i> | 31.12.23 <i>Audited</i> | 31.12.22 ¹ <i>Unaudited</i> | 31.12.22 ² <i>Audited</i> | 30.06.24 ³ <i>Unaudited</i> | |
| Total assets | 963,570 | 974,587 | 975,683 | 934,422 | not applicable |
| Senior debt (securities issued) ⁴ | 96,270 | 64,926 | 63,605 | not available | not applicable |
| Subordinated debt (securities issued) | 12,158 | 12,474 | 12,474 | not available | not applicable |
| Financial assets measured at amortised cost - Loans to customers | 486,051 | 495,197 | 495,194 | not available | not applicable |

¹ The comparative figures as at 31 December 2022 included in the 2023 Annual Report have been presented according to the 8th update to the Bank of Italy Circular 262/2005 and adjusted for the application of IFRS 9 – IFRS 17 by the insurance companies of the Group. As a result, these comparative figures have been identified as unaudited.

² Figures from the 2022 Annual Report.

³ The financial information relating to 30 June 2024 has been extracted from the press release issued by Intesa Sanpaolo S.p.A. on 30 July 2024 and entitled "Intesa Sanpaolo: Consolidated Results as at 30 June 2024" (the "30 July 2024 Press Release"). The financial information indicated as "not available" has not been inserted in the 30 July 2024 Press Release.

⁴ Securities issued not accounted for as subordinated debt.

| | | | | | |
|---|---------|--------------------|--------------------|---------------|--------------------|
| Financial liabilities measured at amortised cost - Due to customers | 440,449 | 454,595 | 454,025 | not available | not applicable |
| Share capital | 10,369 | 10,369 | 10,369 | 10,369 | not applicable |
| Non performing loans | 4,965 | 5,496 | 5,496 | 4,758 | not applicable |
| Common Equity Tier 1 capital (CET1) ratio (%) | 13.7% | 13.8% ⁵ | 13.8% ⁵ | 13.5% | 9.35% ⁶ |
| Total Capital Ratio | 19.2% | 19.1% ⁵ | 19.1% ⁵ | 19.3% | not available |

What are the key risks that are specific to the Issuer?

Risk exposure to debt securities issued by sovereign States

The market tensions regarding government bonds and their volatility, as well as Italy's rating downgrading or the forecast that such downgrading may occur, might have negative effects on the assets, the economic and/or financial situation, the operational results and the perspectives of the Bank. Intesa Sanpaolo Group results are and will be exposed to sovereign debtors, in particular to Italy and certain major European Countries.

Risks related to legal proceedings

The risk arising from legal proceedings consists of the possibility of the Bank being obliged to pay any sum in case of unfavourable outcome.

Risks related to the economic/financial crisis and the impact of current uncertainties of the macro-economic context

The future development in the macro-economic context may be considered as a risk as it may produce negative effects and trends in the economic and financial situation of the Bank and/or the Group. Any negative variations of the factors that affect the macro-economic framework, in particular during periods of economic-financial crisis, could lead the Bank and/or the Group to suffer losses, increases of financing costs, and reductions of the value of the assets held, with a potential negative impact on the liquidity of the Bank and/or the Group and its financial soundness.

Credit risk

The economic and financial activity and soundness of the Bank depend on its borrower's creditworthiness. The Bank is exposed to the traditional risks related to credit activity. Therefore, the clients' breach of the agreements entered into and of their underlying obligations, or any lack of information or incorrect information provided by them as to their respective financial and credit position, could have negative effects on the economic and/or financial situation of the Bank.

Market risk

The market risk is the risk of losses in the value of financial instruments, including the securities of sovereign States held by the Bank, due to the movements of market variables (by way of example and without limitation, interest rates, prices of securities, exchange rates), which could determine a deterioration of the financial soundness of the Bank and/or the Group. Such deterioration could be produced either by negative effects on the income statement deriving from positions held for trading purposes, or from negative changes in the FVOCI (Fair Value through Other Comprehensive Income) reserve, generated by positions classified as financial activities evaluated at fair value, with an impact on the overall profitability.

Liquidity risk of Intesa Sanpaolo

Although the Bank constantly monitors its own liquidity risk, any negative development of the market situation and the general economic context and/or creditworthiness of the Bank, may have negative effects on the activities and the economic and/or financial situation of the Bank and the Group. In particular, in light of the findings set forth in the EBA third report on LCR and NSFR monitoring⁷, the Issuer remains attentive to the evolution of the funding market to ensure that its ordinary refinancing strategies and normal business are not affected by the cumulative effect of the maturity of all the remaining central bank funding and additional outflows due to the impact of adverse market liquidity scenarios. The liquidity risk is the risk that the Bank is not able to satisfy its payment obligations at maturity, both due to the inability to raise funds on the market (funding liquidity risk) and of the difficulty to disinvest its own assets (market liquidity risk).

Operational risk

The Bank is exposed to several categories of operational risk which are intrinsic to its business, among which those mentioned herein, by way of example and without limitation: frauds by external persons, frauds or losses arising from the unfaithfulness of the employees

⁵ Transitional.

⁶ Countercyclical Capital Buffer calculated taking into account the exposure as at 30 June 2024 in the various countries where the Group has a presence, as well as the respective requirements set by the competent national authorities and relating to 2025, where available, or the most recent update of the reference period (requirement was set at zero per cent in Italy for the first nine months of 2024).

⁷ EBA Report on "Monitoring of liquidity coverage ratio and net stable funding ratio implementation in the EU" of 15 June 2023.

and/or breach of control procedures, operational errors, defects or malfunctions of computer or telecommunication systems, computer virus attacks, default of suppliers with respect to their contractual obligations, terrorist attacks and natural disasters. The occurrence of one or more of said risks may have significant negative effects on the business, the operational results and the economic and financial situation of the Bank.

Risk related to the development of the banking sector regulation and the changes in the regulation on the solution of banking crises

The Bank is subject to a complex and strict regulation, as well as to the supervisory activity performed by the relevant institutions (in particular, the European Central Bank, the Bank of Italy and CONSOB). Both the aforementioned regulation and supervisory activity are subject, respectively, to continuous updates and practice developments. Furthermore, as a listed Bank, the Bank is required to comply with further provisions issued by CONSOB. The Bank, besides the supranational and national rules and the primary or regulatory rules of the financial and banking sector, is also subject to specific rules on anti-money laundering, usury and consumer protection. Although the Bank undertakes to comply with the set of rules and regulations, any changes of the rules and/or changes of the interpretation and/or implementation of the same by the competent authorities could give rise to new burdens and obligations for the Bank, with possible negative impacts on the operational results and the economic and financial situation of the Bank.

Section 3 – Key information on the Securities

Type, class and ISIN

The Securities are Warrants. The Securities are issued in Italian dematerialized form ("**Italian Dematerialized Securities**").

The Warrants are European Style Warrants. The Warrants are Call Covered Warrants.

The Warrants are cash settled.

In relation to each Series of Warrants, the relevant ISIN Code is set out in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below.

Currency, denomination, and term of the securities

The indicative price of each Series of Covered Warrants determined on the basis of the market parameters on 3 October 2024 is equal to the amount specified per each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below (the "**Indicative Price**").

The Securities are issued in EUR (the "**Issue Currency**").

The Settlement Currency is EUR.

The Securities are European Style Warrants and will be automatically exercised on the relevant Exercise Date.

The Exercise Date of the Warrants is set out in relation to each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below.

The Settlement Date of the Warrants falls two Business Days following the relevant Exercise Date.

Rights attached to the securities

The Warrants and any non-contractual obligations arising out of or in connection with the Warrants will be governed by, and shall be construed in accordance with, English Law. The registration and transfer of the Securities in Monte Titoli shall be governed by, and shall be construed in accordance with, Italian law.

The Warrants entitle its holder to receive from the Issuer the following amount.

CASH SETTLEMENT AMOUNT

The Securityholder will receive on the Settlement Date for each Minimum Exercise Number, specified for each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below, the payment of the Cash Settlement Amount (if positive) determined as follows:

CALL COVERED WARRANTS

CALCULATION METHOD IN THE CASE OF POSITIVE AND NEGATIVE PERFORMANCE OF THE UNDERLYING

The investor will receive an amount equal to the maximum between (i) 0 and (ii) the Final Reference Value less the Exercise Price. The result will be multiplied by the Multiplier (equal to the amount specified for each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below) and the Minimum Exercise Number (equal to 10 Covered Warrants for each Series, as specified for each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below).

For the purposes of the above the following applies:

The Final Reference Value will be registered on the relevant Valuation Date, which falls on the Business Day prior to the relevant Exercise Date, and will be an amount equal to:

- the reference price of the relevant Share in relation to the Series that specify Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. as Exchange in the "Annex to the Final Terms and to the Summary";

- the closing price of the relevant Share in relation to the Series that do not specify Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. as Exchange in the "Annex to the Final Terms and to the Summary".

The Exercise Price is equal to the amount specified for each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary" below.

The Underlyings are the Shares specified for each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary".

In respect of the Underlyings, certain historical information (including past performance thereof) may be found on major information providers, such as Bloomberg and Reuters, and on the website of the relevant issuer. The relevant Bloomberg Code and the website of the relevant issuer are specified for each Series in the "Annex to the Final Terms and to the Summary".

Seniority of the securities

The Warrants constitute direct, unsubordinated, unconditional and unsecured obligations of the Issuer and, unless provided otherwise by law, rank *pari passu* among themselves and (save for certain obligations required to be preferred by law) rank equally with all other unsecured obligations (other than subordinated obligations, if any) of the Issuer from time to time outstanding.

Restrictions on the free transferability

The Securities will be freely transferable, subject to the offering and selling restrictions in the United States, the European Economic Area under the Prospectus Regulation and the laws of any jurisdiction in which the relevant Securities are offered or sold.

Where will the securities be traded?

Application has been made for the Securities to be admitted to trading on the Italian multilateral trading facility SeDeX, organised and managed by Borsa Italiana S.p.A., which is not a regulated market for the purposes of Directive 2014/65/EU as amended, with effect from the Issue Date or a date around the Issue Date.

After the Issue Date, application may be made to list the Securities on other stock exchanges or regulated markets or to admit to trading on other trading venues as the Issuer may decide.

What are the key risks that are specific to the securities?

The Covered Warrants may not be a suitable investment for all investors

Covered Warrants are complex financial instruments. A potential investor should not invest in Covered Warrants which are complex financial instruments unless it has the expertise (either alone or with the help of a financial adviser) to evaluate how the Covered Warrants will perform under changing conditions, the resulting effects on the value of the Covered Warrants and the impact this investment will have on the potential investor's overall investment portfolio.

General risks and risks relating to the Underlying

The Securities involve a high degree of risk, which may include, among others, interest rate, foreign exchange, time value and political risks. Purchasers should be prepared to sustain a partial or total loss of the purchase price of their Securities. Fluctuations in the value of the relevant Underlying will affect the value of the Securities. Purchasers of Securities risk losing their entire investment or part of it if the value of the relevant underlying basis of reference does not move in the anticipated direction.

Certain considerations associated with Share Securities

In the case of Securities relating to a share or to a GDR/ADR (or basket of shares or basket of GDRs/ADRs), no issuer of such shares will have participated in the preparation of the relevant Final Terms or in establishing the terms of the Securities and neither the Issuer nor any Manager will make any investigation or enquiry in connection with such offering with respect to any information concerning any such issuer of shares contained in such Final Terms or in the documents from which such information was extracted. Consequently, there can be no assurance that all events occurring prior to the relevant issue date that would affect the trading price of the shares will have been publicly disclosed. Subsequent disclosure of any such events or the disclosure of or failure to disclose material future events concerning such an issuer of shares could affect the trading price of the shares and therefore the trading price of the Securities. Securityholders will not have voting rights or rights to receive dividends or distributions or any other rights with respect to the relevant shares to which such Securities relate.

Certain factors affecting the value and trading price of Securities

The Cash Settlement Amount at any time prior to the expiration is typically expected to be less than the trading price of the Securities at that time. The difference between the trading price and the Cash Settlement Amount will reflect, among other things, a "time value" for the Securities. The "time value" of the Securities will depend partly upon the length of the period remaining to expiration and the expectations concerning the value of the Underlying. Securities offer hedging and investment diversification opportunities but also pose some additional risks with regard to interim value. The interim value of the Securities varies with the price of the Underlying, as well as a number of other interrelated factors.

Loss risk in relation to the Covered Warrants

An investment in Covered Warrants entails the risk of loss of the capital invested. In particular, in relation to Call Covered Warrants,

in case of negative performance of the Underlying, if the Final Reference Value is lower than the Exercise Price, the investor will bear a total loss of the capital invested. Furthermore, if the Final Reference Value is higher than the Exercise Price, but not enough to offset the price paid for the purchase of the Covered Warrants, the investor will bear a partial loss of the capital invested.

Risk related to the Exercise Price

The Cash Settlement Amount of the Covered Warrants will be calculated also on the basis of the Exercise Price, which is a value predetermined by the Issuer. Such Exercise Price contributes to the determination of the potential return of the Covered Warrants.

Possible illiquidity of the Securities in the secondary market

It is not possible to predict the price at which Securities will trade in the secondary market or whether such market will be liquid or illiquid. The Issuer, or any of its Affiliates may, but is not obliged to, at any time purchase Securities at any price in the open market or by tender or private treaty. Any Securities so purchased may be held or resold or surrendered for cancellation. The Issuer or any of its Affiliates may, but is not obliged to, be a market-maker for an issue of Securities. Even if the Issuer or such other entity is a market-maker for an issue of Securities, the secondary market for such Securities may be limited. To the extent that an issue of Securities becomes illiquid, an investor may have to wait until the Exercise Date to realise value.

Section 4 – Key information on the offer of securities to the public

Under which conditions and timetable can I invest in this security?

Not applicable - the Securities are not being offered to the public as part of a public offer.

Who is the offeror?

Not applicable - the Securities are not being offered to the public as part of a public offer.

Reasons for the offer and estimated net amount of the proceeds

Not applicable - the Securities are not being offered to the public as part of a public offer.

Indication of whether the offer is subject to an underwriting agreement on a firm commitment basis

Not applicable - the Securities are not being offered to the public as part of a public offer.

Indication of the most material conflicts of interest pertaining to the offer or the admission to trading.

The Issuer may enter into hedging arrangements with market counterparties in connection with the issue of the Securities in order to hedge its exposure.

The Issuer will act as Calculation Agent under the Securities.

In addition, the Issuer may act as liquidity provider (as defined under the rules of the relevant market, as amended from time to time) in respect of the Securities.

ANNEX TO THE FINAL TERMS AND TO THE SUMMARY

| Series (Item 1 of Part A) | Covered Warrants Isin Code (Item 8 of Part B and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Covered Warrants Trading Code (Item 8 of Part B) | Underlying (Item 6 of Part A and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Isin Code and Bloomberg Code of the Underlying (Item 6 of Part A and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Website of the issuer of the Underlying (Section 3 of the Issue Specific Summary) | Exercise Price (Item 100 of Part A and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Exercise Date (Item 9 of Part A and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Multiplier (Item 32 of Part A and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Number of Securities issued (Item 1 of Part A) | Minimum Exercise Number (Item 3 of Part A and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Minimum Trading Number (Item 4 of Part A) | Indicative Price per Security (Item 1 of Part A and Section 3 of the Issue Specific Summary) | Exchange (Item 22 of Part A) |
|----------------------------------|--|---|--|--|--|--|---|---|---|---|--|---|-------------------------------------|
| 217 | IT0005615668 | I10422 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 325 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.4515 | XETRA |
| 218 | IT0005615676 | I10423 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 335 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.2735 | XETRA |
| 219 | IT0005615684 | I10424 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 345 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.1640 | XETRA |
| 220 | IT0005615692 | I10425 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 330 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.4090 | XETRA |
| 221 | IT0005615700 | I10426 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 340 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.2690 | XETRA |
| 222 | IT0005615718 | I10427 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 350 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.1755 | XETRA |
| 223 | IT0005615726 | I10428 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 355 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.1415 | XETRA |
| 224 | IT0005615734 | I10429 | Axa SA | FR0000120628 CS FP <Equity> | www.axa.com | 39 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0520 | Euronext Paris |
| 225 | IT0005615742 | I10430 | Axa SA | FR0000120628 CS FP <Equity> | www.axa.com | 41 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0255 | Euronext Paris |
| 226 | IT0005615759 | I10431 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 43 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0130 | Euronext Paris |
| 227 | IT0005615767 | I10432 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 40 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0490 | Euronext Paris |
| 228 | IT0005615775 | I10433 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 42 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0275 | Euronext Paris |
| 229 | IT0005615783 | I10434 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 44 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0160 | Euronext Paris |
| 230 | IT0005615791 | I10435 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 45 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0125 | Euronext Paris |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------------|----------------------------------|------------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 231 | IT0005615809 | I10436 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 26 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0470 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 232 | IT0005615817 | I10437 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 27 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0300 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 233 | IT0005615825 | I10438 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 28 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0190 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 234 | IT0005615833 | I10439 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 26.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0505 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 235 | IT0005615841 | I10440 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 27.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0365 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 236 | IT0005615866 | I10441 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 29 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0225 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 237 | IT0005615874 | I10442 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 30 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0165 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 238 | IT0005615882 | I10443 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 31 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.0120 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 239 | IT0005615890 | I10444 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 13 | 03/03/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0075 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 240 | IT0005615908 | I10445 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 14 | 03/03/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0025 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 241 | IT0005615916 | I10446 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 15 | 03/03/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0010 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 242 | IT0005615924 | I10447 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 13.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0065 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 243 | IT0005615858 | I10448 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 14.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0025 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 244 | IT0005615940 | I10449 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 15.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0010 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 245 | IT0005615957 | I10450 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 16 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0010 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 246 | IT0005615932 | I10451 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 6.8 | 03/03/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0095 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 247 | IT0005615965 | I10452 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7.2 | 03/03/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0060 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 248 | IT0005615973 | I10453 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7.6 | 03/03/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0040 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 249 | IT0005615981 | I10454 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7 | 02/06/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0090 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 250 | IT0005616005 | I10455 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7.4 | 02/06/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0060 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------|----------------------------------|---------------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 251 | IT0005616013 | I10456 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 8 | 02/06/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0035 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 252 | IT0005616021 | I10457 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 8.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0025 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 253 | IT0005615999 | I10458 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 9 | 02/06/2025 | 0.1 | 15,000,000 | 10 | 10 | 0.0015 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 254 | IT0005616047 | I10459 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 89 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1955 | XETRA |
| 255 | IT0005616054 | I10460 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 92 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1510 | XETRA |
| 256 | IT0005616062 | I10461 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 95 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1195 | XETRA |
| 257 | IT0005616039 | I10462 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 90 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1895 | XETRA |
| 258 | IT0005616088 | I10463 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 96 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1170 | XETRA |
| 259 | IT0005616096 | I10464 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 100 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0875 | XETRA |
| 260 | IT0005616104 | I10465 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 105 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0640 | XETRA |
| 261 | IT0005616112 | I10466 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 70 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1210 | Euronext Paris |
| 262 | IT0005616120 | I10467 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 75 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0560 | Euronext Paris |
| 263 | IT0005616138 | I10468 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 80 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0280 | Euronext Paris |
| 264 | IT0005616146 | I10469 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 72.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0955 | Euronext Paris |
| 265 | IT0005616070 | I10470 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 77.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0530 | Euronext Paris |
| 266 | IT0005616153 | I10471 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 82.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0315 | Euronext Paris |
| 267 | IT0005616161 | I10472 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 85 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0250 | Euronext Paris |
| 268 | IT0005616187 | I10473 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 5.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0245 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 269 | IT0005616195 | I10474 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0130 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------|----------------------------------|-------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 270 | IT0005616203 | I10475 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0070 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 271 | IT0005616179 | I10476 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 5.75 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0195 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 272 | IT0005616211 | I10477 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6.25 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0120 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 273 | IT0005616237 | I10478 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6.75 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0070 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 274 | IT0005616229 | I10479 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 7 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0060 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 275 | IT0005616245 | I10480 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 7.25 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0045 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 276 | IT0005616252 | I10481 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 17 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0720 | XETRA |
| 277 | IT0005616260 | I10482 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 18.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0375 | XETRA |
| 278 | IT0005616286 | I10483 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 20 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0200 | XETRA |
| 279 | IT0005616294 | I10484 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 18 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0710 | XETRA |
| 280 | IT0005616302 | I10485 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 19 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0515 | XETRA |
| 281 | IT0005616310 | I10486 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 20.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0325 | XETRA |
| 282 | IT0005616278 | I10487 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 21 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0285 | XETRA |
| 283 | IT0005616328 | I10488 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 8 | 03/03/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0065 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 284 | IT0005616344 | I10489 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 8.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0025 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 285 | IT0005616351 | I10490 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 9 | 03/03/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0015 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 286 | IT0005616336 | I10491 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 8.25 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0095 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 287 | IT0005616369 | I10492 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 9.25 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0030 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 288 | IT0005616393 | I10493 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 10 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0020 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 289 | IT0005616377 | I10494 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 11 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0015 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-----------------|---------------------------------|-----------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 290 | IT0005616401 | I10495 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 15 | 03/03/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0505 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 291 | IT0005616419 | I10496 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 16.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0190 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 292 | IT0005616427 | I10497 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 18 | 03/03/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0090 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 293 | IT0005616385 | I10498 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 15.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0410 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 294 | IT0005616443 | I10499 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 17 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0175 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 295 | IT0005616435 | I10500 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 18.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0085 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 296 | IT0005616468 | I10501 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 19 | 02/06/2025 | 0.1 | 30,000,000 | 10 | 10 | 0.0070 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 297 | IT0005616450 | I10502 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 28.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0460 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 298 | IT0005616476 | I10503 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 29.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0300 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 299 | IT0005616484 | I10504 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 31 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0165 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 300 | IT0005616500 | I10505 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 29 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0400 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 301 | IT0005616518 | I10506 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 30 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0275 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 302 | IT0005616492 | I10507 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 32 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0140 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 303 | IT0005616526 | I10508 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 33 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0105 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 304 | IT0005616534 | I10509 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 34 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0085 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 305 | IT0005616542 | I10510 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 71.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.2370 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 306 | IT0005616559 | I10511 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 73 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.1925 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 307 | IT0005616567 | I10512 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 74.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.1550 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 308 | IT0005616575 | I10513 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 72 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.3470 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 309 | IT0005616583 | I10514 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 75 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.2585 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------------|-----------------------------------|-----------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 310 | IT0005616591 | I10515 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 77 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.2105 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 311 | IT0005616609 | I10516 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 80 | 02/06/2025 | 0.1 | 5,000,000 | 10 | 10 | 0.1535 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 312 | IT0005616617 | I10517 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 45.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0555 | Euronext Paris |
| 313 | IT0005616625 | I10518 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 47.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0345 | Euronext Paris |
| 314 | IT0005616633 | I10519 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 49.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0215 | Euronext Paris |
| 315 | IT0005616641 | I10520 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 46.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0610 | Euronext Paris |
| 316 | IT0005616658 | I10521 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 48.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0430 | Euronext Paris |
| 317 | IT0005616666 | I10522 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 50 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0330 | Euronext Paris |
| 318 | IT0005616674 | I10523 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 52 | 02/06/2025 | 0.1 | 8,000,000 | 10 | 10 | 0.0230 | Euronext Paris |
| 319 | IT0005616682 | I10524 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 14.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0325 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 320 | IT0005616690 | I10525 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 15.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0205 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 321 | IT0005616708 | I10526 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 16 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0165 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 322 | IT0005616716 | I10527 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 16.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0220 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 323 | IT0005616724 | I10528 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 17.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0170 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 324 | IT0005616732 | I10529 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 18.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0135 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 325 | IT0005616740 | I10530 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 19 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0125 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 326 | IT0005616757 | I10531 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 30 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1215 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 327 | IT0005616765 | I10532 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 32.5 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0720 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 328 | IT0005616781 | I10533 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 35 | 03/03/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0435 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 329 | IT0005616799 | I10534 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 31.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.1365 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|------------------|-----------------------------------|--------------------------|-------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 330 | IT0005616807 | I10535 | STMicronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 33.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0975 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 331 | IT0005616815 | I10536 | STMicronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 34.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0820 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 332 | IT0005616823 | I10537 | STMicronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 36 | 02/06/2025 | 0.1 | 10,000,000 | 10 | 10 | 0.0635 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 333 | IT0005616831 | I10538 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 43 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.1220 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 334 | IT0005616773 | I10539 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 45 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0835 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 335 | IT0005616849 | I10540 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 47 | 03/03/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0580 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 336 | IT0005616856 | I10541 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 44 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.1360 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 337 | IT0005616864 | I10542 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 46 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0995 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 338 | IT0005616872 | I10543 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 48 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0730 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 339 | IT0005616880 | I10544 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 49 | 02/06/2025 | 0.1 | 20,000,000 | 10 | 10 | 0.0625 | Euronext Milan of Borsa Italiana S.p.A. |
| 340 | IT0005616898 | I10545 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 110 | 03/03/2025 | 0.1 | 3,000,000 | 10 | 10 | 0.1695 | XETRA |
| 341 | IT0005616906 | I10546 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 115 | 03/03/2025 | 0.1 | 3,000,000 | 10 | 10 | 0.1145 | XETRA |
| 342 | IT0005616914 | I10547 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 120 | 03/03/2025 | 0.1 | 3,000,000 | 10 | 10 | 0.0800 | XETRA |
| 343 | IT0005616922 | I10548 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 112.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 3,000,000 | 10 | 10 | 0.1730 | XETRA |
| 344 | IT0005616930 | I10549 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 117.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 3,000,000 | 10 | 10 | 0.1200 | XETRA |
| 345 | IT0005616948 | I10550 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 122.5 | 02/06/2025 | 0.1 | 3,000,000 | 10 | 10 | 0.0840 | XETRA |
| 346 | IT0005616955 | I10551 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 125 | 02/06/2025 | 0.1 | 3,000,000 | 10 | 10 | 0.0705 | XETRA |

La presente costituisce una traduzione di cortesia non ufficiale in lingua italiana della versione in lingua inglese dei Final Terms relativi all'emissione "130 Series of CALL COVERED WARRANTS on Shares due 03.03.2025 and 02.06.2025" effettuata a valere sul Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking di Intesa Sanpaolo S.p.A.. Tale traduzione è stata predisposta da Intesa Sanpaolo S.p.A. al fine esclusivo di agevolare la lettura del testo in lingua inglese dei Final Terms da parte dei potenziali investitori. Fermo restando quanto previsto dalla normativa applicabile relativa alla Nota di Sintesi della singola emissione e alla relativa traduzione in lingua italiana, Intesa Sanpaolo S.p.A. non si assume né accetta alcuna responsabilità in merito alla correttezza della traduzione dei Final Terms. Il testo in lingua inglese prevarrà in caso di eventuale divergenza con la traduzione italiana, o di omissioni nell'ambito della stessa.

CONDIZIONI DEFINITIVE

11 ottobre 2024

Intesa Sanpaolo S.p.A.

Codice LEI (Legal Entity Identifier): 2W8N8UU78PMDQKZENC08

130 Serie di COVERED WARRANTS DI TIPO CALL su Azioni con scadenza 03.03.2025 e 02.06.2025

"Intesa Sanpaolo S.p.A. Covered Warrants su Azioni di tipo Call Scadenza 03.03.2025 e 02.06.2025"

a valere sul Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking

PARTE A – CONDIZIONI CONTRATTUALI

I termini utilizzati nel presente documento devono considerarsi definiti come nei Termini e Condizioni del Prospetto di Base del 12 giugno 2024 e del supplemento al Prospetto di Base del 2 agosto 2024, che insieme costituiscono un prospetto di base ai sensi del Regolamento Prospetto come successivamente modificato. Il presente documento contiene le Condizioni Definitive dei Titoli descritti ai sensi dell'art. 8(1) del Regolamento Prospetto e deve essere letto congiuntamente al Prospetto di Base, come supplementato. Le informazioni complete relative all'Emittente e all'offerta dei Titoli sono desumibili solamente dalla lettura congiunta delle presenti Condizioni Definitive e del Prospetto di Base, come supplementato. È possibile prendere visione del Prospetto di Base e del supplemento al Prospetto di Base presso la sede legale dell'Emittente durante il normale orario di apertura. Il Prospetto di Base e il supplemento al Prospetto di Base sono pubblicati sui siti web del Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com) e dell'Emittente (www.prodottiequotazioni.intesasanpaolo.com). Alle presenti Condizioni Definitive è allegata la nota di sintesi della singola emissione relativa ai Titoli. Nel caso di Titoli ammessi alla negoziazione sul mercato regolamentato del Luxembourg Stock Exchange, le Condizioni Definitive saranno pubblicate sul sito web del Luxembourg Stock Exchange e dell'Emittente.

I riferimenti qui contenuti a Condizioni numerate s'intendono ai termini e alle condizioni delle relative serie di Titoli e le parole e le espressioni definite in tali termini e condizioni avranno lo stesso significato nelle presenti Condizioni Definitive nella misura in cui si riferiscono a tali serie di Titoli, salvo ove diversamente specificato.

Le presenti Condizioni Definitive sono riferite alle serie di Titoli definite al successivo paragrafo "Disposizioni specifiche per ciascuna Serie". I riferimenti ai "Titoli" ivi contenuti devono essere considerati riferimenti ai relativi Warrants che sono oggetto delle presenti Condizioni Definitive e i riferimenti ai "Titoli" e al "Titolo" devono essere interpretati di conseguenza.

1. Disposizioni specifiche per ciascuna Serie:

| Numero di Serie | Numero di Titoli emessi | Prezzo Indicativo per Titolo |
|------------------------|--|---|
| da 217 a 346 | Il numero di Titoli emessi è indicato in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto | Il Prezzo Indicativo di ciascuna Serie di Covered Warrant, determinato sulla base di parametri di mercato il 3 ottobre 2024, è pari all'importo indicato in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto |

| | | |
|-----|---|---|
| 2. | Numero di Tranche: | Non applicabile |
| 3. | Numero Minimo di Esercizio: | Il Numero Minimo di Esercizio è indicato in relazione a ciascuna Serie, nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto |
| 4. | Numero Minimo di Negoziazione: | Il Numero Minimo di Negoziazione è indicato in relazione a ciascuna Serie, nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto |
| 5. | Consolidamento: | Non applicabile |
| 6. | Tipo di Titoli e Attività Sottostante(i): | (a) I Titoli sono Covered Warrants. I Warrants sono Warrants di Stile Europeo. (b) Le attività finanziarie cui sono collegati i Titoli sono le azioni indicate nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto (le " Azioni " o le " Attività Sottostanti "). |
| 7. | Attività Sottostante di Riferimento: | Non applicabile |
| 8. | Tipologia: | Covered Warrants di tipo Call |
| 9. | (i) Data di Esercizio: | La Data di Esercizio dei Titoli è indicata in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto |
| | (ii) Orario Limite dell'Avviso di Rinuncia: | Pari al relativo Giorno di Valutazione. |
| 10. | Data di Liquidazione: | La Data di Liquidazione dei Titoli cade due Giorni Lavorativi successivi alla relativa Data di Esercizio. Qualora nel relativo Giorno di Valutazione si verifichi un Evento di Sconvolgimento di Mercato, la relativa Data di Liquidazione verrà postposta di conseguenza. Tale Data di Liquidazione non potrà, in nessun caso, essere postposta oltre il decimo Giorno Lavorativo successivo al relativo Giorno di Valutazione. |
| 11. | Data di Regolamento: | Non applicabile |
| 12. | Data di Emissione: | La Data di Emissione è il 9 ottobre 2024. |
| 13. | Valuta di Emissione: | La Valuta di Emissione è l'Euro. |
| 14. | Prezzo di Acquisto: | Non applicabile |
| 15. | Giorno Lavorativo: | Non applicabile |
| 16. | Giorno Lavorativo di Negoziazione: | Non applicabile |
| 17. | Giorno Lavorativo di Liquidazione: | Non applicabile |
| 18. | Liquidazione: | La liquidazione sarà effettuata mediante pagamento in contanti (" Titoli Liquidati in Contanti "). |

| | | |
|-----|---|---|
| 19. | Tasso di Cambio: | Non applicabile |
| 20. | Valuta di Liquidazione: | La Valuta di Liquidazione ai fini del pagamento dell'Importo di Liquidazione è l'Euro. |
| 21. | Nome e indirizzo dell'Agente di calcolo: | L'Agente di Calcolo è Intesa Sanpaolo S.p.A., con sede legale in Piazza San Carlo, 156 – 10121 Torino, Italia. |
| 22. | Mercato(i): | Il relativo Mercato è indicato nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto. |
| 23. | Fonte di Riferimento: | La Fonte di Riferimento è, in relazione a ciascuna Serie, il relativo Mercato. |
| 24. | Mercato(i) Correlato(i): | Il relativo Mercato Correlato è: <ul style="list-style-type: none"> - <i>Euronext Derivatives Milan</i> di Borsa Italiana S.p.A., in relazione alle Serie che hanno come Mercato <i>Euronext Milan</i> di Borsa Italiana S.p.A. nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto; - EUREX, in relazione alle Serie che hanno come Mercato <i>Euronext Paris</i> nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto; - EUREX, in relazione alle Serie che hanno come Mercato <i>XETRA</i> nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto. |
| 25. | Caratteristica Futures Contract N-th Near-by: | Non applicabile |
| 26. | Caratteristica Open End: | Non applicabile |
| 27. | Opzione Put: | Non applicabile |
| 28. | Opzione Call: | Non applicabile |
| 29. | Livello Massimo: | Non applicabile |
| 30. | Livello Minimo: | Non applicabile |
| 31. | Importo di Liquidazione: | <p>Alla Data di Liquidazione ciascun Covered Warrant dà diritto al portatore di ricevere un Importo di Liquidazione in Contanti nella Valuta di Liquidazione calcolato dall'Agente di Calcolo secondo la seguente formula e il cui risultato è arrotondato a un centesimo di Euro (0,005 Euro viene arrotondato per eccesso):</p> $\text{Max } [0; (\text{Valore di Riferimento Finale} - \text{Prezzo di Esercizio})] \times \text{Multiplo} \times \text{Numero Minimo di Esercizio}$ |
| 32. | Multiplo: | Il Multiplo da applicarsi è indicato in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto |
| 33. | Beni Rilevanti: | Non applicabile |
| 34. | Entitlement: | Non applicabile |
| 35. | AMF: | Non applicabile |
| 36. | VMF: | Non applicabile |

| | | |
|-----|--|--|
| 37. | Fattore Index Leverage: | Non applicabile |
| 38. | Fattore Constant Leverage: | Non applicabile |
| 39. | Prezzo di Strike: | Non applicabile |
| 40. | Tasso di Conversione: | Non applicabile |
| 41. | Valuta di Riferimento dell'Attività Sottostante: | La Valuta di Riferimento dell'Attività Sottostante è l'Euro. |
| 42. | Opzione Quanto: | Non applicabile |
| 43. | Data(e) di Determinazione: | Non applicabile |
| 44. | Giorno(i) di Valutazione: | Il Giorno di Valutazione cade il Giorno Lavorativo precedente alla relativa Data di Esercizio. |
| 45. | Valore Infragiornaliero | Non applicabile |
| 46. | Valore di Riferimento: | Non applicabile |
| 47. | Valore di Riferimento Iniziale: | Non applicabile |
| | Periodo(i) di Determinazione del Valore di Riferimento Iniziale: | Non applicabile |
| 48. | Valore di Riferimento Finale: | Il Valore di Riferimento Finale, ai fini del calcolo dell'Importo di Liquidazione, sarà rilevato nel relativo Giorno di Valutazione e sarà un valore pari: <ul style="list-style-type: none"> – al prezzo di riferimento della relativa Azione in relazione alle Serie che hanno come Mercato <i>Euronext Milan</i> di Borsa Italiana S.p.A. nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi"; – al prezzo di chiusura della relativa Azione in relazione alle Serie che non hanno come Mercato <i>Euronext Milan</i> di Borsa Italiana S.p.A. nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi". |
| | Periodo(i) di Determinazione del Valore di Riferimento Finale: | Non applicabile |
| 49. | Caratteristica Best Of: | Non applicabile |
| 50. | Caratteristica Worst Of: | Non applicabile |
| 51. | Caratteristica Rainbow: | Non applicabile |
| 52. | Reverse Split: | Non applicabile |

DISPOSIZIONI RELATIVE AI CERTIFICATI

Non applicabile

| | | |
|-----|--|-----------------|
| 53. | Performance Cap: | Non applicabile |
| | Performance Floor: | Non applicabile |
| | Fattore di Partecipazione della Performance: | Non applicabile |

| | | |
|-----|-----------------------------------|-----------------|
| 54. | Percentuale Iniziale: | Non applicabile |
| 55. | Fattore di Partecipazione: | Non applicabile |
| 56. | Fattore di Partecipazione Down: | Non applicabile |
| 57. | Fattore di Partecipazione Up: | Non applicabile |
| 58. | Leverage Iniziale: | Non applicabile |
| 59. | Evento Barriera: | Non applicabile |
| 60. | Evento Barriera Gap: | Non applicabile |
| 61. | Livello(i) Cap: | Non applicabile |
| 62. | Percentuale Floor: | Non applicabile |
| 63. | Evento Consolidation Floor: | Non applicabile |
| 64. | Importo Barriera Cap: | Non applicabile |
| 65. | Importo Cap Down: | Non applicabile |
| 66. | Percentuale Strike: | Non applicabile |
| 67. | Percentuale Calendar Cap: | Non applicabile |
| 68. | Percentuale Calendar Floor: | Non applicabile |
| 69. | Fattore Gearing: | Non applicabile |
| 70. | Evento One Star: | Non applicabile |
| 71. | Evento Switch: | Non applicabile |
| 72. | Evento Multiple Strike: | Non applicabile |
| 73. | Spread: | Non applicabile |
| 74. | Evento Gearing: | Non applicabile |
| 75. | Evento Buffer: | Non applicabile |
| 76. | Performance Globale: | Non applicabile |
| 77. | Mancata Consegna per Illiquidità: | Non applicabile |
| 78. | Percentuale Digital: | Non applicabile |
| 79. | Livello di Liquidazione: | Non applicabile |
| 80. | Importo Combinato: | Non applicabile |
| 81. | Caratteristica Darwin: | Non applicabile |

DISPOSIZIONI RELATIVE AGLI IMPORTI DI REMUNERAZIONE E ALL'IMPORTO DI ESERCIZIO ANTICIPATO

Non applicabile

| | | |
|-----|---|-----------------|
| 82. | Caratteristica Knock-out: | Non applicabile |
| 83. | Caratteristica Knock-in: | Non applicabile |
| 84. | Importo(i) Digital: | Non applicabile |
| 85. | Caratteristica Restrike: | Non applicabile |
| 86. | Importo(i) Plus: | Non applicabile |
| 87. | Importo(i) Accumulated: | Non applicabile |
| 88. | Importo(i) di Esercizio Anticipato: | Non applicabile |
| 89. | Pagamento Anticipato Parziale del Capitale: | Non applicabile |
| 90. | Importo Cumulated Bonus: | Non applicabile |
| 91. | Evento Coupon: | Non applicabile |
| 92. | Importo Internal Return: | Non applicabile |
| 93. | Importo Participation Remuneration: | Non applicabile |
| 94. | Importo Participation Rebate: | Non applicabile |
| 95. | Importo Variabile: | Non applicabile |
| 96. | Importo Premium Gap: | Non applicabile |

DISPOSIZIONI RELATIVE AI WARRANTS

Applicabile.

| | | |
|------|--|---|
| 97. | Tipo di Warrants: | (i) i Warrants sono Warrants di Stile Europeo (ii) i Warrants sono Call Covered Warrants |
| 98. | Importo Nozionale: | Non applicabile |
| 99. | Day Count Fraction: | Non applicabile |
| 100. | Prezzo di Esercizio: | Il Prezzo di Esercizio dei Titoli è indicato in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto |
| 101. | Premio: | Il Premio è pari al Prezzo Indicativo per ciascun Covered Warrant. |
| 102. | Evento Barriera: | Non applicabile |
| | Periodo(i) di Determinazione dell'Evento Barriera: | Non applicabile |
| | Periodo(i) di Valutazione della Barriera: | Non applicabile |
| | Livello Barriera Inferiore: | Non applicabile |

| | | |
|------|--|-----------------|
| | Livello Barriera Superiore: | Non applicabile |
| | Importo Anticipato Corridor: | Non applicabile |
| | Data di Pagamento Anticipato Corridor: | Non applicabile |
| 103. | Percentuale Strike: | Non applicabile |
| 104. | Periodo di Esercizio: | Non applicabile |
| 105. | Numero Massimo di Esercizio: | Non applicabile |
| 106. | Periodo di Determinazione di Liquidazione: | Non applicabile |
| 107. | Data di Determinazione di Liquidazione: | Non applicabile |

DISPOSIZIONI GENERALI

| | | |
|------|---|-----------------------------------|
| 108. | Forma dei Titoli: | Titoli Dematerializzati Italiani. |
| 109. | Divieto di Vendita alla clientela <i>retail</i> : | Non applicabile |

DISTRIBUZIONE

| | | |
|------|---------------|-----------------|
| 110. | Sindacazione: | Non applicabile |
|------|---------------|-----------------|

INFORMAZIONI SUPPLEMENTARI

Esempio(i) di strumenti derivati complessi: Non applicabile

Sottoscritto per conto dell'Emittente:

Da:
Debitamente autorizzato

PARTE B – ALTRE INFORMAZIONI

1. QUOTAZIONE E AMMISSIONE ALLA NEGOZIAZIONE

- (i) Quotazione: Nessuna
- (ii) Ammissione alla negoziazione: È stata presentata richiesta di ammissione dei Titoli alla negoziazione presso il sistema multilaterale di negoziazione SeDeX organizzato e gestito da Borsa Italiana S.p.A., che non è un mercato regolamentato ai sensi della Direttiva 2014/65/UE come modificata, con effetto a partire dalla Data di Emissione o da una data intorno alla Data di Emissione.
- Successivamente alla Data di Emissione, potrà essere presentata richiesta di quotazione dei Titoli su altre borse valori o mercati regolamentati, o di ammissione alla negoziazione su altre sedi di negoziazione, a scelta dell'Emittente.

2. NOTIFICA

La CSSF ha inviato alla Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) un certificato di approvazione che attesta la conformità del Prospetto di Base al Regolamento Prospetto.

3. INTERESSI DI PERSONE FISICHE E GIURIDICHE COINVOLTE NELL'EMISSIONE

L'Emittente potrà stipulare accordi di copertura con controparti di mercato in relazione all'emissione dei Titoli ai fini di copertura della propria esposizione finanziaria.

L'Emittente agirà come Agente di Calcolo ai sensi dei Titoli. Si rinvia al fattore di rischio "Potential Conflicts of Interest" del Prospetto di Base.

Inoltre, l'Emittente potrà agire come *liquidity provider* (come definito ai sensi delle regole del mercato di riferimento, come di volta in volta modificate) in relazione ai Titoli.

4. RAGIONI DELL'OFFERTA, PROVENTI NETTI STIMATI E SPESE TOTALI

- (i) Ragioni dell'offerta: Non applicabile
- (ii) Proventi netti stimati: Non applicabile
- (iii) Spese totali stimate: Non applicabile

5. TERMINI E CONDIZIONI DELL'OFFERTA

Non applicabile

6. DISTRIBUZIONE

- (i) Nomi e indirizzi, per quanto a conoscenza dell'Emittente, dei Collocatori / Distributori nei vari paesi in cui ha luogo l'offerta: Nessuno
- (ii) Nomi e indirizzi dei coordinatori dell'offerta globale e delle singole parti dell'offerta: Non applicabile
- (iii) Nomi e indirizzi di eventuali altri agenti per i pagamenti e agenti depositari nei singoli paesi (oltre all'Agente Principale): Non applicabile

per i Titoli):

- (iv) Soggetti che hanno accettato di sottoscrivere l'emissione con impegno irrevocabile e soggetti che hanno accettato di collocare l'emissione senza impegno irrevocabile o su base "*best efforts*": Non applicabile
- (v) Data della firma del contratto di collocamento: Non applicabile

7. INFORMAZIONI SUCCESSIVE ALL'EMISSIONE

L'Emittente non intende fornire eventuali informazioni successive all'emissione salvo che non sia previsto da leggi e regolamenti applicabili.

8. INFORMAZIONI OPERATIVE

- (i) Codice ISIN: In relazione a ciascuna Serie, il Codice ISIN è indicato nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto
- (ii) Codice di Negoziazione: In relazione a ciascuna Serie, il Codice di Negoziazione è indicato nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto
- (iii) Altri sistemi di compensazione diversi da Euroclear Bank SA/NV e Clearstream Banking S.A., e relativi numeri di identificazione: Monte Titoli S.p.A.

PARTE C – NOTA DI SINTESI DELLA SINGOLA EMISSIONE DEI TITOLI

| |
|--|
| Sezione 1 – Introduzione contenente avvertenze |
| Denominazione dei Titoli: 130 Serie di COVERED WARRANTS DI TIPO CALL su Azioni con scadenza 03.03.2025 e 02.06.2025 (in relazione a ciascuna Serie di Warrants, il Codice ISIN è indicato nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto). |
| Emittente: Intesa Sanpaolo S.p.A. (Intesa Sanpaolo , la Banca o l' Emittente) Indirizzo: Piazza San Carlo 156, 10121 Torino, Italia Numero di telefono: +39 011 555 1 Sito web: www.prodottiequotazioni.intesasanpaolo.com Codice identificativo del soggetto giuridico (LEI): 2W8N8UU78PMDQKZENC08 |
| Autorità competente: <i>Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF)</i> , 283, route d'Arlon L-1150 Luxembourg. Numero di telefono: (+352) 26 25 1 - 1. |
| Data di approvazione del Prospetto di Base: Warrants and Certificates Programme IMI Corporate & Investment Banking approvato dalla CSSF il 12 giugno 2024. |
| La presente Nota di Sintesi deve essere letta come introduzione al Prospetto di Base. Qualsiasi decisione d'investimento nei Titoli dovrebbe basarsi sull'esame da parte dell'investitore del Prospetto di Base completo. L'investitore potrebbe incorrere in una perdita totale o parziale del capitale investito. Qualora sia presentato un ricorso dinanzi all'autorità giudiziaria in merito alle informazioni contenute nel Prospetto di Base, l'investitore ricorrente potrebbe essere tenuto, a norma del diritto nazionale degli Stati membri, a sostenere le spese di traduzione del Prospetto di Base (inclusi eventuali supplementi e le Condizioni Definitive) prima dell'inizio del procedimento. La responsabilità civile incombe solo sulle persone che hanno presentato la nota di sintesi, comprese le sue eventuali traduzioni, ma soltanto se la Nota di Sintesi risulti fuorviante, imprecisa o incoerente se letta insieme con le altre parti del Prospetto di Base o non offra, se letta congiuntamente alle altre sezioni del Prospetto di Base, le informazioni fondamentali per aiutare gli investitori a valutare l'opportunità di investire nei Titoli. |
| Stare per acquistare un prodotto che non è semplice e può essere di difficile comprensione. |
| Sezione 2 – Informazioni fondamentali concernenti l'Emittente |
| Chi è l'emittente dei titoli? |
| L'Emittente è Intesa Sanpaolo S.p.A., iscritto nel Registro delle Imprese di Torino al n. 00799960158 e all'Albo Nazionale delle Banche al numero meccanografico 5361 ed è la capogruppo del Gruppo Intesa Sanpaolo. Intesa Sanpaolo S.p.A. opera ed è soggetta alla Normativa Bancaria. |
| Domicilio e forma giuridica, codice LEI, ordinamento in base alla quale opera e paese in cui ha sede Il codice identificativo del soggetto giuridico (LEI) di Intesa Sanpaolo è 2W8N8UU78PMDQKZENC08. L'Emittente è una banca italiana costituita in forma di società per azioni. La sede legale e amministrativa dell'Emittente è in Piazza San Carlo 156, 10121 Torino, Italia. L'Emittente è costituito e opera ai sensi della legge italiana. L'Emittente, sia in quanto banca sia in quanto capogruppo del Gruppo Intesa Sanpaolo, è assoggettato a vigilanza prudenziale da parte della Banca d'Italia e della Banca Centrale Europea. |
| Attività principali L'Emittente è un istituto bancario che svolge attività di investment banking. L'Emittente offre una vasta gamma di servizi relativi ai mercati di capitali, investment banking e servizi di credito specifici ad una clientela diversificata, inclusi banche, società, investitori istituzionali, enti e organizzazioni pubbliche. L'Emittente è la capogruppo del Gruppo Intesa Sanpaolo che opera mediante sei divisioni: la divisione Banca dei Territori, la divisione <i>Corporate and Investment Banking</i> , la divisione <i>International Subsidiary Banks</i> , la divisione <i>Private Banking</i> , la divisione <i>Asset Management</i> e la divisione <i>Insurance</i> . |
| Maggiori azionisti, compreso se è direttamente o indirettamente posseduto o controllato e da quali soggetti Alla data del 31 dicembre 2023, l'azionariato dell'Emittente risulta così composto (titolari di quote superiori al 3%): Fondazione Compagnia di San Paolo (azioni ordinarie: 1.188.947.304; di possesso: 6,503%); Fondazione Cariplo (azioni ordinarie: 961.333.900; di possesso: 5,258%). |
| Identità dei suoi principali amministratori delegati L'amministratore delegato dell'Emittente è Carlo Messina (<i>Chief Executive Officer</i>). |

Identità dei suoi revisori legali

EY S.p.A., con sede legale in Via Lombardia, 31 – 00187 Roma, ha ricevuto dall'Emittente l'incarico di revisione legale del proprio bilancio per gli esercizi 2021-2029.

Quali sono le informazioni finanziarie fondamentali relative all'Emittente?

| | Conto Economico Consolidato | | | | | |
|--|--------------------------------|---|---|---|------------------------------------|--|
| | Per l'anno concluso al | | | Per i sei mesi chiusi al | | |
| <i>Milioni di Euro, salvo dove indicato</i> | 31.12.23 <i>Revisionato</i> | 31.12.22 ¹ <i>Non revisionato</i> | 31.12.22 ² <i>Revisionato</i> | 30.06.24 ³ <i>Non revisionato</i> | 30.06.23 <i>Non revisionato</i> | |
| Margine d'interesse | 16.936 | 11.835 | 9.685 | non disponibile | non disponibile | |
| Commissioni nette | 7.801 | 8.373 | 8.577 | non disponibile | non disponibile | |
| Risultato netto dell'attività di negoziazione | 513 | 36 | (149) | non disponibile | non disponibile | |
| Rettifiche/riprese di valore nette per rischio di credito | (1.416) | (2.636) | (2.624) | non disponibile | non disponibile | |
| Risultato netto della gestione finanziaria e assicurativa | 23.026 | 18.016 | 18.483 | non disponibile | non disponibile | |
| Utile (Perdita) d'esercizio di pertinenza della capogruppo | 7.724 | 4.379 | 4.354 | 4.766 | 4.222 | |
| | Stato Patrimoniale Consolidato | | | | | |
| | Per l'anno concluso al | | | Per i sei mesi chiusi al | | Valore come risultato dal processo di revisione e valutazione prudenziale (requisito 'SREP' per il 2024) |
| <i>Milioni di Euro, salvo dove indicato</i> | 31.12.23 <i>Revisionato</i> | 31.12.22 ¹ <i>Non revisionato</i> | 31.12.22 ² <i>Revisionato</i> | 30.06.24 ³ <i>Non revisionato</i> | | |
| Totale attività | 963.570 | 974.587 | 975.683 | 934.422 | non applicabile | |
| Debito di primo rango senior (titoli emessi) ⁴ | 96.270 | 64.926 | 63.605 | non disponibile | non applicabile | |
| Passività subordinate (titoli emessi) | 12.158 | 12.474 | 12.474 | non disponibile | non applicabile | |
| Attività finanziarie valutate al costo ammortizzato – | 486.051 | 495.197 | 495.194 | non disponibile | non applicabile | |

¹ I dati comparativi al 31 dicembre 2022 inclusi nel Bilancio Annuale del 2023 sono stati presentati secondo l'8° aggiornamento della Circolare 262/2005 della Banca d'Italia e rettificati per l'applicazione degli IFRS 9 - IFRS 17 da parte delle società assicurative del Gruppo. Di conseguenza, tali dati comparativi sono stati identificati come non revisionati.

² Dati estratti dal Bilancio Annuale del 2022.

³ Le informazioni finanziarie relative al 30 giugno 2024 sono state estratte dal comunicato stampa di Intesa Sanpaolo S.p.A. del 30 luglio 2024 intitolato "Intesa Sanpaolo: Risultati Consolidati al 30 giugno 2024" (il "Comunicato Stampa del 30 luglio 2024"). Le informazioni finanziarie indicate come "non disponibile" non erano incluse nel Comunicato Stampa del 30 luglio 2024.

⁴ Titoli emessi non contabilizzati come debito subordinato.

| | | | | | |
|---|---------|--------------------|--------------------|-----------------|--------------------|
| Crediti verso la clientela | | | | | |
| Passività finanziarie valutate al costo ammortizzato – Debiti verso clientela | 440.449 | 454.595 | 454.025 | non disponibile | non applicabile |
| Capitale | 10.369 | 10.369 | 10.369 | 10.369 | non applicabile |
| Crediti deteriorati | 4.965 | 5.496 | 5.496 | 4.758 | non applicabile |
| Common Equity Tier 1 capital (CET1) ratio (%) | 13,7% | 13,8% ⁵ | 13,8% ⁵ | 13,5% | 9,35% ⁶ |
| Total Capital Ratio | 19,2% | 19,1% ⁵ | 19,1% ⁵ | 19,3% | non disponibile |

Quali sono i principali rischi specifici dell'Emittente?

Rischio connesso all'esposizione al debito sovrano

Le tensioni sui mercati dei titoli di Stato e la loro volatilità, nonché il declassamento del rating dell'Italia o la previsione che tale declassamento possa verificarsi, potrebbero avere effetti negativi sull'attivo, sulla situazione economica e/o finanziaria, sui risultati operativi e sulle prospettive della Banca. I risultati del Gruppo Intesa Sanpaolo sono e saranno esposti al debito sovrano, in particolare a quello italiano e a quello di alcuni importanti Paesi europei.

Rischi connessi ai procedimenti giudiziari

Il rischio connesso a procedimenti giudiziari consiste nella possibilità che la Banca sia obbligata a sostenere i costi derivanti da esiti sfavorevoli degli stessi.

Rischi connessi alla crisi economico-finanziaria e all'impatto delle attuali incertezze del contesto macroeconomico

Lo sviluppo futuro del contesto macroeconomico può essere considerato un rischio in quanto può produrre effetti e dinamiche negative sulla situazione economica, patrimoniale e finanziaria della Banca e/o del Gruppo. Eventuali variazioni negative dei fattori che incidono nel contesto macroeconomico, in particolare in periodi di crisi economico-finanziaria, potrebbero comportare per la Banca e/o il Gruppo perdite, aumenti dei costi di finanziamento e riduzioni di valore delle attività detenute, con un potenziale impatto negativo sulla liquidità della Banca e/o del Gruppo e sulla sua solidità finanziaria.

Rischio di credito

L'attività economica e finanziaria e la solidità della Banca dipendono dall'affidabilità creditizia dei debitori. La Banca è esposta ai tradizionali rischi connessi all'attività creditizia. Pertanto, la violazione da parte dei clienti dei contratti stipulati e degli obblighi ad essi sottostanti, o l'eventuale carenza di informativa o l'inesattezza delle informazioni da essi fornite in merito alla rispettiva posizione finanziaria e creditizia, potrebbe avere effetti negativi sulla situazione economica e/o finanziaria della Banca.

Rischio di mercato

Il rischio di mercato consiste nel rischio di subire perdite di valore su strumenti finanziari, inclusi i titoli di Stati sovrani detenuti dalla Banca, a causa dell'andamento delle variabili di mercato (a titolo esemplificativo e non esaustivo, tassi di interesse, prezzi dei titoli, tassi di cambio), che potrebbero determinare un deterioramento della solidità finanziaria della Banca e/o del Gruppo. Tale deterioramento potrebbe essere prodotto da effetti negativi sul conto economico derivanti da posizioni detenute a fini di negoziazione, così come da variazioni negative della riserva FVOCI (*Fair Value through Other Comprehensive Income*), generate da posizioni classificate come attività finanziarie valutate al *fair value*, con un impatto sulla redditività complessiva.

Rischio di liquidità di Intesa Sanpaolo

Sebbene la Banca monitori costantemente il proprio rischio di liquidità, qualsiasi sviluppo negativo della situazione di mercato e del contesto economico generale e/o del merito creditizio della Banca, può avere effetti negativi sulle attività e sulla situazione economica e/o finanziaria della Banca e del Gruppo. In particolare, alla luce di quanto emerso dal terzo rapporto dell'EBA sul monitoraggio del LCR e del NSFR⁷, l'Emittente rimane attento all'evoluzione del mercato dei finanziamenti per garantire che le proprie strategie di rifinanziamento ordinario e la normale attività non siano influenzati dall'effetto cumulativo della scadenza di tutti i restanti finanziamenti della banca centrale e da ulteriori deflussi dovuti all'impatto di scenari avversi sulla liquidità del mercato. Il rischio di liquidità è il rischio che la Banca non sia in grado di soddisfare i propri obblighi di pagamento alla scadenza, sia per l'incapacità di reperire fondi sul mercato (*funding liquidity risk*) che per la difficoltà di smobilizzare le proprie attività (*market liquidity risk*).

⁵ Transitorio.

⁶ *Countercyclical Capital Buffer* calcolato tenendo conto dell'esposizione al 30 giugno 2024 nei vari Paesi in cui il Gruppo è presente, nonché dei rispettivi requisiti stabiliti dalle autorità nazionali competenti e relativi al 2025, ove disponibili, o al più recente aggiornamento del periodo di riferimento (il requisito è stato fissato a zero per cento in Italia i primi nove mesi del 2024).

⁷ Report EBA sul "Monitoraggio dell'attuazione del coefficiente di copertura della liquidità e del coefficiente netto di finanziamento stabile nell'UE" del 15 giugno 2023.

Rischio operativo

La Banca è esposta a diverse categorie di rischio operativo strettamente connesse alla sua attività, tra le quali, a titolo esemplificativo e non esaustivo: frodi da parte di soggetti esterni, frodi o perdite derivanti dall'infedeltà dei dipendenti e/o dalla violazione delle procedure di controllo, errori operativi, difetti o malfunzionamenti dei sistemi informatici o di telecomunicazione, attacchi con virus informatici, inadempienze dei fornitori rispetto ai loro obblighi contrattuali, attacchi terroristici e calamità naturali. Il verificarsi di uno o più di tali rischi può avere significativi effetti negativi sull'attività, sui risultati operativi e sulla situazione economica e finanziaria della Banca.

Rischio connesso all'evoluzione della regolamentazione del settore bancario e alle modifiche alla regolamentazione relativa alla risoluzione delle crisi bancarie

La Banca è soggetta ad una complessa e rigorosa regolamentazione, nonché all'attività di vigilanza svolta dalle istituzioni competenti (in particolare, la Banca Centrale Europea, la Banca d'Italia e la CONSOB). Sia tale regolamentazione che l'attività di vigilanza sono soggette, rispettivamente, ad un continuo aggiornamento e all'evoluzione della prassi. Inoltre, in quanto Banca quotata, la Banca è tenuta a rispettare le ulteriori disposizioni emanate dalla CONSOB. La Banca, oltre alle norme sovranazionali e nazionali e alle norme primarie o regolamentari del settore finanziario e bancario, è soggetta anche a specifiche norme in materia di antiriciclaggio, usura e tutela dei consumatori. Sebbene la Banca si impegni a rispettare l'insieme delle norme e dei regolamenti, eventuali modifiche delle norme e/o modifiche dell'interpretazione e/o dell'attuazione delle stesse da parte delle autorità competenti potrebbero comportare nuovi oneri e obblighi per la Banca, con possibili impatti negativi sui risultati operativi e sulla situazione economica e finanziaria della Banca.

Sezione 3 – Informazioni fondamentali sui Titoli

Tipologia, classe e codice ISIN

I Titoli sono Warrants. I Titoli sono emessi in forma dematerializzata italiana ("**Titoli Dematerializzati Italiani**").

I Warrants sono Warrants di Stile Europeo. I Warrants sono Covered Warrants di tipo Call.

I Warrants sono liquidati in contanti.

In relazione a ciascuna Serie di Warrants, il Codice ISIN è indicato nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto.

Valuta, valore nominale dei titoli emessi e durata dei titoli

Il prezzo indicativo di ciascuna Serie di Covered Warrant, determinato sulla base di parametri di mercato il 3 ottobre 2024, è pari all'importo indicato in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto (il "**Prezzo Indicativo**").

I Titoli sono emessi in Euro (la "**Valuta di Emissione**").

La Valuta di Liquidazione è l'Euro.

I Titoli sono Warrants di Stile Europeo e saranno esercitati automaticamente alla relativa Data di Esercizio.

La Data di Esercizio dei Warrants è indicata in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto.

La Data di Liquidazione dei Warrants cade due Giorni Lavorativi successivi alla relativa Data di Esercizio.

Diritti connessi ai titoli

I Warrants e qualsiasi altra obbligazione extracontrattuale derivante da o relativa ai Warrants sarà disciplinata e interpretata in base alla legge inglese. La registrazione e il trasferimento dei Titoli presso Monte Titoli saranno disciplinati e interpretati in base alla legge italiana.

I Warrants danno diritto al portatore di ricevere dall'Emittente il seguente importo.

IMPORTO DI LIQUIDAZIONE IN CONTANTI

I Portatori riceveranno alla Data di Liquidazione per ciascun Numero Minimo di Esercizio, indicato in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto, il pagamento dell'Importo di Liquidazione (ove positivo) determinato come segue.

CALL COVERED WARRANTS

MODALITÀ DI CALCOLO APPLICABILI IN CASO DI PERFORMANCE POSITIVA E NEGATIVA DELL'ATTIVITÀ SOTTOSTANTE

L'investitore riceverà un importo pari al maggiore tra (i) 0 e (ii) il Valore di Riferimento Finale meno il Prezzo di Esercizio. Il risultato sarà moltiplicato per il Multiplo (pari all'importo indicato in relazione a ciascuna Serie nell'Allegato alla Nota di Sintesi) e per il Numero Minimo di Esercizio (pari a 10 Covered Warrants in relazione a ciascuna Serie, come indicato nell'Allegato alla Nota di Sintesi).

Per le finalità di cui sopra si applica quanto segue:

Il Valore di Riferimento Finale sarà rilevato nel relativo Giorno di Valutazione, che cade il Giorno Lavorativo precedente alla relativa Data di Esercizio, e sarà un valore pari:

- al prezzo di riferimento della relativa Azione in relazione alle Serie che hanno come Mercato *Euronext Milan* di Borsa Italiana S.p.A. nell'Allegato alla Nota di Sintesi;
- al prezzo di chiusura della relativa Azione in relazione alle Serie che non hanno come Mercato *Euronext Milan* di Borsa Italiana S.p.A..

Il Prezzo di Esercizio è pari all'importo indicato in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto.

Le Attività Sottostanti sono le Azioni indicate in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto.

In relazione alle Attività Sottostanti, alcune informazioni storiche (comprese le performance passate delle stesse) sono reperibili attraverso i principali data providers, quali Bloomberg e Reuters e sul sito internet del relativo emittente. Il relativo Codice Bloomberg e il sito internet del relativo emittente sono indicati in relazione a ciascuna Serie nell'"Allegato alle Condizioni Definitive e alla Nota di Sintesi" di cui sotto.

Rango dei titoli

I Warrants costituiscono obbligazioni dirette, non subordinate e non garantite dell'Emittente e, salvo diversamente previsto dalla legge, non sussistono clausole di postergazione tra i Titoli stessi, e (salvo in relazione a certe obbligazioni la cui preferenza è imposta dalla legge) avranno pari grado rispetto a tutte le altre obbligazioni non garantite (diverse dalle obbligazioni non subordinate, ove presenti) dell'Emittente, di volta in volta in essere.

Restrizioni alla libera negoziabilità dei titoli

I Warrants saranno liberamente trasferibili, fatte salve le restrizioni sull'offerta e la vendita previste negli Stati Uniti, nello Spazio Economico Europeo ai sensi del Regolamento Prospetto e delle leggi di qualsiasi giurisdizione in cui i relativi Titoli sono offerti o venduti.

Dove saranno negoziati i titoli?

È stata presentata richiesta di ammissione dei Titoli alla negoziazione presso il sistema multilaterale di negoziazione SeDeX, organizzato e gestito da Borsa Italiana S.p.A., che non è un mercato regolamentato ai sensi della Direttiva 2014/65/UE come modificata, con effetto a partire dalla Data di Emissione o da una data intorno alla Data di Emissione.

Successivamente alla Data di Emissione, potrà essere presentata richiesta di quotazione dei Titoli su altre borse valori o mercati regolamentati, o di ammissione alla negoziazione su altre sedi di negoziazione, a scelta dell'Emittente.

Quali sono i principali rischi specifici dei titoli?

I Covered Warrants possono non essere un investimento adatto a tutti gli investitori

I Covered Warrants sono strumenti finanziari complessi. Un potenziale investitore non dovrebbe investire in Covered Warrants che sono strumenti finanziari complessi senza possedere l'esperienza (da solo o con l'aiuto di un consulente finanziario) per valutare quale sia l'andamento dei Covered Warrants sotto condizioni mutevoli, gli effetti che si producono sul valore dei Covered Warrants e l'impatto che tale investimento avrà sul portafoglio complessivo dell'investitore.

Rischi generali e rischi relativi all'Attività Sottostante

I Covered Warrants comportano un alto grado di rischio che può includere, tra le altre cose, i rischi relativi al tasso d'interesse, al tasso di cambio, al valore nel tempo e alla situazione politica. Gli acquirenti devono essere pronti a sostenere una perdita parziale o totale del prezzo di acquisto dei loro Titoli. Le variazioni del valore della relativa Attività Sottostante incideranno sul valore dei Titoli. Gli acquirenti corrono il rischio di perdere l'intero o parte del loro investimento se il valore della relativa Attività Sottostante non dovesse muoversi nella direzione prevista.

Alcune considerazioni relative ai Titoli legati ad Azioni

In caso di Titoli legati a un'azione o a GDRs/ADRs (o un paniere di azioni o un paniere di GDRs/ADRs), nessun emittente di tali azioni parteciperà alla redazione delle relative Condizioni Definitive o stabilirà le condizioni dei Titoli e né l'Emittente né i Collocatori effettueranno alcuna indagine in relazione a tale offerta riguardo a qualsiasi informazione relativa a tale emittente di azioni contenuta nelle Condizioni Definitive o nei documenti da cui tali informazioni sono estratte. Di conseguenza, non vi è alcuna garanzia che tutti gli eventi verificatisi prima della relativa data di emissione che potrebbero influenzare il prezzo delle azioni siano stati resi pubblici. Un'informativa successiva o una mancata informativa in merito a tali eventi o a eventi futuri che riguardano l'emittente di tali azioni potrebbe influenzare negativamente il prezzo di negoziazione delle azioni e, di conseguenza, il prezzo di negoziazione dei Titoli. I Portatori non avranno diritti di voto o diritto di ricevere dividendi o distribuzioni o qualsiasi altro diritto relativo alle azioni cui tali Titoli sono legati.

Alcuni fattori che influenzano il valore e prezzo di negoziazione dei Titoli

L'Importo di Liquidazione in qualsiasi momento precedente alla scadenza è presumibilmente inferiore al prezzo di negoziazione nello stesso momento. La differenza tra il prezzo di negoziazione e l'Importo di Liquidazione riflette, tra l'altro, un "valore temporale" per i Titoli. Il "valore temporale" dei Titoli dipenderà in parte dal periodo di tempo che rimane fino alla scadenza e dalle aspettative relative al valore dell'Attività Sottostante. I Titoli offrono opportunità di copertura e diversificazione dell'investimento, ma pongono altresì ulteriori rischi relativi al loro valore temporaneo. Il valore temporaneo dei Titoli varia al variare del prezzo dell'Attività Sottostante, nonché in relazione ad altri fattori correlati.

Rischio di perdita in relazione ai Covered Warrants

Un investimento nei Covered Warrants comporta un rischio di perdita del capitale investito. In particolare, in relazione ai Call Covered Warrants, in caso di performance negativa dell'Attività Sottostante, qualora il Valore di Riferimento Finale sia inferiore al Prezzo di Esercizio, l'investitore subirà una perdita totale del capitale investito. Inoltre, qualora il Valore di Riferimento Finale sia superiore al Prezzo di Esercizio, ma non in misura sufficiente per compensare il prezzo pagato per l'acquisto dei Covered Warrants, l'investitore subirà una perdita parziale del capitale investito.

Rischio relativo al Prezzo di Esercizio

L'Importo di Liquidazione dei Covered Warrants sarà calcolato anche sulla base del Prezzo di Esercizio, che è un valore predeterminato dall'Emittente. Tale Prezzo di Esercizio contribuisce alla determinazione del potenziale guadagno derivante dall'investimento nei Covered Warrants.

Possibile illiquidità dei Titoli sul mercato secondario

Non è possibile prevedere il prezzo al quale i Titoli saranno scambiati sul mercato secondario o se tale mercato sarà liquido o illiquido. L'Emittente, o qualsiasi altra sua Società Affiliata, in qualsiasi momento, potrà, ma non sarà obbligato a, acquistare i Titoli a qualsiasi prezzo sul mercato o mediante offerta o trattativa privata. Qualsiasi Titolo così acquistato potrà essere detenuto o rivenduto o restituito per la cancellazione. L'Emittente, o qualsiasi altra sua Società Affiliata potrà, ma non sarà obbligato ad essere un market maker per l'emissione di Titoli. Anche se l'Emittente o tale altro soggetto è un market maker per l'emissione di Titoli, il mercato secondario di tali Titoli può essere limitato. Nella misura in cui un'emissione di Titoli diventi illiquida, un investitore potrebbe dover aspettare fino alla Data di Esercizio per ottenerne il valore.

Sezione 4 – Informazioni fondamentali sull'offerta pubblica di titoli

A quali condizioni posso investire in questo titolo e qual è il calendario previsto?

Non applicabile – i Titoli non sono offerti al pubblico nell'ambito di un'offerta pubblica.

Chi è l'offerente?

Non applicabile – i Titoli non sono offerti al pubblico nell'ambito di un'offerta pubblica.

Ragioni dell'offerta e proventi netti stimati

Non applicabile – i Titoli non sono offerti al pubblico nell'ambito di un'offerta pubblica.

Indicazione se l'offerta è soggetta a un accordo di sottoscrizione con assunzione a fermo

Non applicabile – i Titoli non sono offerti al pubblico nell'ambito di un'offerta pubblica.

Indicazione dei conflitti di interesse più significativi che riguardano l'offerta o l'ammissione alla negoziazione

L'Emittente potrà stipulare accordi di copertura con controparti di mercato in relazione all'emissione dei Titoli ai fini di copertura della propria esposizione finanziaria.

L'Emittente agirà come Agente di Calcolo ai sensi dei Titoli.

Inoltre, l'Emittente potrà agire come *liquidity provider* (come definito ai sensi delle regole del mercato di riferimento, come di volta in volta modificate) in relazione ai Titoli.

ALLEGATO ALLE CONDIZIONI DEFINITIVE E ALLA NOTA DI SINTESI

| Serie (Punto 1 della Parte A) | Codice Isin dei Covered Warrants (Punto 8 della Parte B e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Codice di Negoziazione e dei Covered Warrants (Punto 8 della Parte B) | Attività Sottostante (Punto 6 della Parte A e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Codice Isin e Codice Bloomberg dell'Attività Sottostante (Punto 6 della Parte A e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Sito web dell'emittente dell'Attività Sottostante (Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Prezzo di Esercizio (Punto 100 della Parte A e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Data di Esercizio (Punto 9 della Parte A e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Multiplo (Punto 32 della Parte A e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Numero di Titoli emessi (Punto 1 della Parte A) | Numero Minimo di Esercizio (Punto 3 della Parte A e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Numero Minimo di Negoziazione (Punto 4 della Parte A) | Prezzo Indicativo per Titolo (Punto 1 della Parte A e Sezione 3 della Nota di Sintesi della Specifica Emissione) | Mercato (Punto 22 della Parte A) |
|-------------------------------|--|---|--|--|---|---|---|---|---|--|---|--|----------------------------------|
| 217 | IT0005615668 | I10422 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 325 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,4515 | XETRA |
| 218 | IT0005615676 | I10423 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 335 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,2735 | XETRA |
| 219 | IT0005615684 | I10424 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 345 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,1640 | XETRA |
| 220 | IT0005615692 | I10425 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 330 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,4090 | XETRA |
| 221 | IT0005615700 | I10426 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 340 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,2690 | XETRA |
| 222 | IT0005615718 | I10427 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 350 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,1755 | XETRA |
| 223 | IT0005615726 | I10428 | Allianz SE | DE0008404005 ALV GY <Equity> | www.allianz.com | 355 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,1415 | XETRA |
| 224 | IT0005615734 | I10429 | Axa SA | FR0000120628 CS FP <Equity> | www.axa.com | 39 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0520 | Euronext Paris |
| 225 | IT0005615742 | I10430 | Axa SA | FR0000120628 CS FP <Equity> | www.axa.com | 41 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0255 | Euronext Paris |
| 226 | IT0005615759 | I10431 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 43 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0130 | Euronext Paris |
| 227 | IT0005615767 | I10432 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 40 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0490 | Euronext Paris |
| 228 | IT0005615775 | I10433 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 42 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0275 | Euronext Paris |
| 229 | IT0005615783 | I10434 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 44 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0160 | Euronext Paris |
| 230 | IT0005615791 | I10435 | Axa SA | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.axa.com | 45 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0125 | Euronext Paris |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------------|----------------------------------|------------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 231 | IT0005615809 | I10436 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 26 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0470 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 232 | IT0005615817 | I10437 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 27 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0300 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 233 | IT0005615825 | I10438 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 28 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0190 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 234 | IT0005615833 | I10439 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 26,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0505 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 235 | IT0005615841 | I10440 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 27,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0365 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 236 | IT0005615866 | I10441 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 29 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0225 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 237 | IT0005615874 | I10442 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 30 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0165 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 238 | IT0005615882 | I10443 | Azimut Holding S.p.A. | IT0003261697 AZM IM <Equity> | www.azimut.it | 31 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,0120 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 239 | IT0005615890 | I10444 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 13 | 03/03/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0075 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 240 | IT0005615908 | I10445 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 14 | 03/03/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0025 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 241 | IT0005615916 | I10446 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 15 | 03/03/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0010 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 242 | IT0005615924 | I10447 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 13,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0065 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 243 | IT0005615858 | I10448 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 14,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0025 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 244 | IT0005615940 | I10449 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 15,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0010 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 245 | IT0005615957 | I10450 | Banca Mediolanum S.p.A. | IT0004776628 BMED IM <Equity> | www.bancamediolanum.it | 16 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0010 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 246 | IT0005615932 | I10451 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 6,8 | 03/03/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0095 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 247 | IT0005615965 | I10452 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7,2 | 03/03/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0060 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 248 | IT0005615973 | I10453 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7,6 | 03/03/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0040 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 249 | IT0005615981 | I10454 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7 | 02/06/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0090 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 250 | IT0005616005 | I10455 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 7,4 | 02/06/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0060 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------|----------------------------------|---------------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 251 | IT0005616013 | I10456 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 8 | 02/06/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0035 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 252 | IT0005616021 | I10457 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 8,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0025 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 253 | IT0005615999 | I10458 | Banco BPM S.p.A. | IT0005218380 BAMI IM <Equity> | www.gruppo.bancobpm.it | 9 | 02/06/2025 | 0,1 | 15.000.000 | 10 | 10 | 0,0015 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 254 | IT0005616047 | I10459 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 89 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1955 | XETRA |
| 255 | IT0005616054 | I10460 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 92 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1510 | XETRA |
| 256 | IT0005616062 | I10461 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 95 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1195 | XETRA |
| 257 | IT0005616039 | I10462 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 90 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1895 | XETRA |
| 258 | IT0005616088 | I10463 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 96 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1170 | XETRA |
| 259 | IT0005616096 | I10464 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 100 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0875 | XETRA |
| 260 | IT0005616104 | I10465 | BMW AG | DE0005190003 BMW GY <Equity> | www.bmwgroup.com | 105 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0640 | XETRA |
| 261 | IT0005616112 | I10466 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 70 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1210 | Euronext Paris |
| 262 | IT0005616120 | I10467 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 75 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0560 | Euronext Paris |
| 263 | IT0005616138 | I10468 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 80 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0280 | Euronext Paris |
| 264 | IT0005616146 | I10469 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 72,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0955 | Euronext Paris |
| 265 | IT0005616070 | I10470 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 77,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0530 | Euronext Paris |
| 266 | IT0005616153 | I10471 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 82,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0315 | Euronext Paris |
| 267 | IT0005616161 | I10472 | BNP Paribas SA | FR0000131104 BNP FP <Equity> | www.invest.bnpparibas.com | 85 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0250 | Euronext Paris |
| 268 | IT0005616187 | I10473 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 5,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0245 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 269 | IT0005616195 | I10474 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0130 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------|----------------------------------|-------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 270 | IT0005616203 | I10475 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0070 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 271 | IT0005616179 | I10476 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 5,75 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0195 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 272 | IT0005616211 | I10477 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6,25 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0120 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 273 | IT0005616237 | I10478 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 6,75 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0070 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 274 | IT0005616229 | I10479 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 7 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0060 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 275 | IT0005616245 | I10480 | BPER Banca S.p.A. | IT0000066123 BPE IM <Equity> | www.group.bper.it | 7,25 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0045 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 276 | IT0005616252 | I10481 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 17 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0720 | XETRA |
| 277 | IT0005616260 | I10482 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 18,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0375 | XETRA |
| 278 | IT0005616286 | I10483 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 20 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0200 | XETRA |
| 279 | IT0005616294 | I10484 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 18 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0710 | XETRA |
| 280 | IT0005616302 | I10485 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 19 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0515 | XETRA |
| 281 | IT0005616310 | I10486 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 20,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0325 | XETRA |
| 282 | IT0005616278 | I10487 | Deutsche Bank AG | DE0005140008 DBK GY <Equity> | www.db.com | 21 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0285 | XETRA |
| 283 | IT0005616328 | I10488 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 8 | 03/03/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0065 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 284 | IT0005616344 | I10489 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 8,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0025 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 285 | IT0005616351 | I10490 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 9 | 03/03/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0015 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 286 | IT0005616336 | I10491 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 8,25 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0095 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 287 | IT0005616369 | I10492 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 9,25 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0030 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 288 | IT0005616393 | I10493 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 10 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0020 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 289 | IT0005616377 | I10494 | Enel S.p.A. | IT0003128367 ENEL IM <Equity> | www.enel.com | 11 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0015 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-----------------|---------------------------------|-----------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 290 | IT0005616401 | I10495 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 15 | 03/03/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0505 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 291 | IT0005616419 | I10496 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 16,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0190 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 292 | IT0005616427 | I10497 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 18 | 03/03/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0090 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 293 | IT0005616385 | I10498 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 15,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0410 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 294 | IT0005616443 | I10499 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 17 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0175 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 295 | IT0005616435 | I10500 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 18,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0085 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 296 | IT0005616468 | I10501 | Eni S.p.A. | IT0003132476 ENI IM <Equity> | www.eni.com | 19 | 02/06/2025 | 0,1 | 30.000.000 | 10 | 10 | 0,0070 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 297 | IT0005616450 | I10502 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 28,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0460 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 298 | IT0005616476 | I10503 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 29,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0300 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 299 | IT0005616484 | I10504 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 31 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0165 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 300 | IT0005616500 | I10505 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 29 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0400 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 301 | IT0005616518 | I10506 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 30 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0275 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 302 | IT0005616492 | I10507 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 32 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0140 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 303 | IT0005616526 | I10508 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 33 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0105 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 304 | IT0005616534 | I10509 | Generali | IT0000062072 G IM <Equity> | www.generali.com | 34 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0085 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 305 | IT0005616542 | I10510 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 71,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,2370 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 306 | IT0005616559 | I10511 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 73 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,1925 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 307 | IT0005616567 | I10512 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 74,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,1550 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 308 | IT0005616575 | I10513 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 72 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,3470 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 309 | IT0005616583 | I10514 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 75 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,2585 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------------|-----------------------------------|-----------------------|------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 310 | IT0005616591 | I10515 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 77 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,2105 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 311 | IT0005616609 | I10516 | Prysmian S.p.A. | IT0004176001 PRY IM <Equity> | www.prysmiangroup.com | 80 | 02/06/2025 | 0,1 | 5.000.000 | 10 | 10 | 0,1535 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 312 | IT0005616617 | I10517 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 45,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0555 | Euronext Paris |
| 313 | IT0005616625 | I10518 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 47,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0345 | Euronext Paris |
| 314 | IT0005616633 | I10519 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 49,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0215 | Euronext Paris |
| 315 | IT0005616641 | I10520 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 46,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0610 | Euronext Paris |
| 316 | IT0005616658 | I10521 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 48,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0430 | Euronext Paris |
| 317 | IT0005616666 | I10522 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 50 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0330 | Euronext Paris |
| 318 | IT0005616674 | I10523 | Renault SA | FR0000131906 RNO FP <Equity> | www.renaultgroup.com | 52 | 02/06/2025 | 0,1 | 8.000.000 | 10 | 10 | 0,0230 | Euronext Paris |
| 319 | IT0005616682 | I10524 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 14,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0325 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 320 | IT0005616690 | I10525 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 15,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0205 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 321 | IT0005616708 | I10526 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 16 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0165 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 322 | IT0005616716 | I10527 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 16,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0220 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 323 | IT0005616724 | I10528 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 17,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0170 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 324 | IT0005616732 | I10529 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 18,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0135 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 325 | IT0005616740 | I10530 | Stellantis N.V. | NL00150001Q9 STLAM IM <Equity> | www.stellantis.com | 19 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0125 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 326 | IT0005616757 | I10531 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 30 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1215 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 327 | IT0005616765 | I10532 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 32,5 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0720 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 328 | IT0005616781 | I10533 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 35 | 03/03/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0435 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 329 | IT0005616799 | I10534 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 31,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,1365 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |

| | | | | | | | | | | | | | |
|-----|--------------|--------|-------------------------|-----------------------------------|--------------------------|-------|------------|-----|------------|----|----|--------|--|
| 330 | IT0005616807 | I10535 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 33,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0975 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 331 | IT0005616815 | I10536 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 34,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0820 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 332 | IT0005616823 | I10537 | STMicroelectronics N.V. | NL0000226223 STMMI IM <Equity> | www.st.com | 36 | 02/06/2025 | 0,1 | 10.000.000 | 10 | 10 | 0,0635 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 333 | IT0005616831 | I10538 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 43 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,1220 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 334 | IT0005616773 | I10539 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 45 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0835 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 335 | IT0005616849 | I10540 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 47 | 03/03/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0580 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 336 | IT0005616856 | I10541 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 44 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,1360 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 337 | IT0005616864 | I10542 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 46 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0995 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 338 | IT0005616872 | I10543 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 48 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0730 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 339 | IT0005616880 | I10544 | UniCredit S.p.A. | IT0005239360 UCG IM <Equity> | www.unicreditgroup.eu | 49 | 02/06/2025 | 0,1 | 20.000.000 | 10 | 10 | 0,0625 | Euronext Milan di Borsa Italiana S.p.A. |
| 340 | IT0005616898 | I10545 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 110 | 03/03/2025 | 0,1 | 3.000.000 | 10 | 10 | 0,1695 | XETRA |
| 341 | IT0005616906 | I10546 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 115 | 03/03/2025 | 0,1 | 3.000.000 | 10 | 10 | 0,1145 | XETRA |
| 342 | IT0005616914 | I10547 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 120 | 03/03/2025 | 0,1 | 3.000.000 | 10 | 10 | 0,0800 | XETRA |
| 343 | IT0005616922 | I10548 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 112,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 3.000.000 | 10 | 10 | 0,1730 | XETRA |
| 344 | IT0005616930 | I10549 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 117,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 3.000.000 | 10 | 10 | 0,1200 | XETRA |
| 345 | IT0005616948 | I10550 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 122,5 | 02/06/2025 | 0,1 | 3.000.000 | 10 | 10 | 0,0840 | XETRA |
| 346 | IT0005616955 | I10551 | Volkswagen AG | DE0007664039 VOW3 GY <Equity> | www.volkswagen-group.com | 125 | 02/06/2025 | 0,1 | 3.000.000 | 10 | 10 | 0,0705 | XETRA |