



AVVISO n.22018	30 Dicembre 2015	SeDeX
---------------------------	------------------	-------

Mittente del comunicato : SOCIETE GENERALE
Societa' oggetto : SG ISSUER
dell'Avviso : SOCIETE GENERALE
Oggetto : Rettifica di strumenti aventi come
sottostante Fiat Chrysler Automobiles

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza dal giorno 4/1/2016 subordinatamente al perfezionamento dell'operazione di assegnazione di azioni FE NEW N.V. agli azionisti di FCA

Milano, 30/12/2015

OGGETTO: RETTIFICA DI CW E CERTIFICATI EMESSI DA SOCIETE GENERALE ED SG ISSUER A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

- **Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:** Nell'esporre quanto segue, il riferimento è all'Avviso n. 21127 del 15 dicembre 2015, mediante il quale le società Fiat Chrysler Automobiles e Ferrari N.V. comunicano l'avvenuta approvazione di Borsa Italiana S.p.A alla quotazione delle azioni ordinarie Ferrari N.V. ("Ferrari").

Le azioni Ferrari saranno negoziate sul segmento MTA a partire dal 4 gennaio 2016, previa pubblicazione del prospetto informativo e subordinatamente al completamento dell'operazione di Separazione tra il 31 dicembre 2015 ed il 3 gennaio 2016. **Subordinatamente alla comunicazione della conclusione dell'iter autorizzativo e al perfezionamento dell'operazione, le seguenti disposizioni saranno confermate da Borsa Italiana mediante apposito Avviso entro le 7:59 di lunedì 4 gennaio 2016.**

L'operazione di Separazione si perfezionerà tramite l'assegnazione di azioni Ferrari agli azionisti di FCA e prevede:

1. la scissione parziale di FCA N.V. a favore di FE Interim B.V. (c.d. "Prima Scissione"),
2. la scissione parziale di FE Interim B.V. a favore di FE New N.V. (c.d. "Seconda Scissione"),
3. il rimborso al valore nominale delle azioni FE Interim B.V. al valore di EUR 0,01 per ogni azione FE Interim B.V. ritirata e annullata,
4. la fusione di Ferrari N.V. in FE New N.V. che assumerà la denominazione di Ferrari N.V.

Il rapporto di assegnazione è dunque fissato a n. 1 azione ordinaria Ferrari (già FE New N.V.) per ogni n. 10 azioni ordinarie FE Interim B.V. (assegnate agli azionisti ordinari di FCA per effetto della Prima Scissione) + EUR 0,01 a titolo di rimborso del valore nominale per ogni n. 1 azione FE Interim B.V. ritirata e annullata

- **Metodologia di rettifica:** sono previste due fasi,
 1. per quanto riguarda i valori di strike, parità (ove presente) e barriera (ove presente), al fine di tener conto del valore di rimborso delle azioni FE Interim B.V. pari ad EUR 0,01 la rettifica sarà effettuata mediante l'impiego del coefficiente K, definito come segue:

$$K = (FCA_{last} - 0,01) / FCA_{last}$$

dove per FCA_{last} si intende il prezzo delle azioni FCA alla chiusura del 30 dicembre 2015.

2. per tutti gli strumenti elencati di seguito, il sottostante verrà modificato e sarà composto da un basket di azioni FCA ex-rimborso ed azioni Ferrari. Stante il già descritto rapporto di assegnazione, il nuovo sottostante sarà così composto:

1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari

- **Data di efficacia:** 04/01/2016 subordinatamente al completamento dell'operazione di Separazione tra il 31 dicembre 2015 ed il 3 gennaio 2016.
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** NL0010877643 per le azioni FCA e NL0011585146 per le azioni Ferrari.
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Coefficiente di Rettifica:** coefficiente $K=0.999226$ come pubblicato tramite Avviso IDEM n°22003 del 30/12/2015.
- **Caratteristiche dei certificates/cw ante e post rettifica in forma tabellare:**

Emittente: Société Générale							
ISIN	Strumento	Sottostante pre-rettifica	Nuovo Sottostante	Strike pre-rettifica	Nuovo Strike	Parità pre-rettifica	Nuova Parità
FR0012562064	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	12	11,9907	0,1	0,1001
FR0012562072	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	14	13,9892	0,1	0,1001
FR0012562098	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0012562130	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012562114	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0012206332	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012206407	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	12	11,9907	0,1	0,1001
FR0012449122	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	14	13,9892	0,1	0,1001
FR0012562155	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0012562163	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012206548	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	6	5,9954	0,1	0,1001
FR0012449130	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0012562239	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	12	11,9907	0,1	0,1001
FR0012562254	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	14	13,9892	0,1	0,1001
FR0012562270	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0012562304	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012562288	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0011191667	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012449148	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	12	11,9907	0,1	0,1001

FR0012449155	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	14	13,9892	0,1	0,1001
FR0012562312	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0011191642	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	6	5,9954	0,1	0,1001
FR0011191659	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0012562346	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0011942523	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	6	5,9954	0,1	0,1001
FR0012449163	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0012562361	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	14	13,9892	0,1	0,1001
FR0012562411	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0012562544	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	18	17,9861	0,1	0,1001
FR0012562577	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012562551	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0012449189	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	12	11,9907	0,1	0,1001
FR0012449197	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0011456235	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	6	5,9954	0,1	0,1001
FR0011456250	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0011456300	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	3	2,9977	0,1	0,1001
FR0011942564	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	6	5,9954	0,1	0,1001
FR0012207710	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012206589	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	14	13,9892	0,1	0,1001
FR0012562593	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	18	17,9861	0,1	0,1001
FR0012562601	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	10	9,9923	0,1	0,1001
FR0012206605	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	6	5,9954	0,1	0,1001
FR0012562627	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0012562643	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	20	19,9845	0,1	0,1001
FR0012562668	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0012562684	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	16	15,9876	0,1	0,1001
FR0012562692	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	20	19,9845	0,1	0,1001
FR0012562718	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0013077278	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	8	7,9938	0,1	0,1001
FR0013077252	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	20	19,9845	0,1	0,1001
FR0013077195	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	18	17,9861	0,1	0,1001
FR0013077187	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	20	19,9845	0,1	0,1001
FR0013077146	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	18	17,9861	0,1	0,1001
FR0013077112	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	18	17,9861	0,1	0,1001
FR0013077096	Covered	Fiat Chrysler	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	12	11,9907	0,1	0,1001

	Warrant	Automobiles					
FR0013077047	Covered Warrant	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	18	17,9861	0,1	0,1001

<i>Emittente: SG Issuer</i>							
<i>ISIN</i>	<i>Strumento</i>	<i>Sottostante pre-rettifica</i>	<i>Nuovo Sottostante</i>	<i>Strike pre-rettifica</i>	<i>Nuovo Strike</i>	<i>Barriera pre-rettifica</i>	<i>Nuova Barriera</i>
LU1003997928	Bonus Cap	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	5,57	5,5657	5,5	5,4957
XS1202717416	Bonus Cap	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	15,12	15,1083	10,584	10,5758
XS1202718224	Bonus Cap	Fiat Chrysler Automobiles	1 Azione FCA + 0,1 Azioni Ferrari	15,12	15,1083	9,072	9,065

- **DATA DI EFFICACIA DELLA RETTIFICA: 04/01/2016** subordinatamente al completamento dell'operazione di Separazione tra il 31 dicembre 2015 ed il 3 gennaio 2016.