



Milano, 14 giugno 2023

Gentile Cliente,

Oggetto: Obbligazione IT0005284341 indicizzata al tasso LIBOR in dollari ("**Obbligazione**") – utilizzo dello USD LIBOR sintetico come tasso di riferimento

Informazioni sul tasso USD LIBOR

Con la comunicazione al mercato del 5 marzo 2021 l'autorità sui mercati finanziari del Regno Unito, Financial Conduct Authority ("**FCA**"), responsabile per la supervisione della pubblicazione del tasso LIBOR in dollari ("**USD LIBOR**"), ha annunciato che, dal 30 giugno 2023 non sarà più garantita la pubblicazione del suddetto tasso, nell'ambito di un processo di sostituzione del tasso USD LIBOR con il tasso alternativo *risk-free* SOFR.

Il 3 aprile 2023, l'FCA ha inoltre ufficializzato la decisione di richiedere all'amministratore dello USD LIBOR di continuare la pubblicazione dei tenor 1M, 3M e 6M per il medesimo indice fino al 30 settembre 2024 secondo la metodologia "sintetica", precisando che tale indice potrà essere utilizzato esclusivamente per alcuni contratti e prodotti, ivi incluse le obbligazioni emesse prima di novembre 2019.

Lo USD LIBOR sintetico è calcolato dall'ICE Benchmark Administration Limited ("**IBA**") sulla base del tasso CME term SOFR a cui è aggiunto un margine di aggiustamento fisso previsto da ISDA in base al tenor di riferimento.

Mediobanca, in conformità con quanto previsto nel prospetto di emissione dell'Obbligazione per il caso di indisponibilità del tasso di riferimento e in linea con le indicazioni dell'FCA, applicherà per il calcolo del pagamento dell'ultima cedola dell'Obbligazione – prima della scadenza prevista per il 12 ottobre 2023 – il tasso USD LIBOR sintetico.

Effetti del passaggio dal tasso USD LIBOR al tasso USD LIBOR sintetico sul Suo contratto

Tenuto conto della comunicazione al mercato della FCA e delle analisi condotte da Mediobanca, vi segnaliamo che dal **1° luglio 2023 (incluso) l'Obbligazione dovrà considerarsi indicizzata al tasso USD LIBOR sintetico (calcolato su un periodo di riferimento di 3 mesi mediante il CME term SOFR maggiorato di un margine di adeguamento ("spread"), stabilito da ISDA, pari al 0,26161%).**

Ulteriori informazioni sulla sostituzione dei tassi LIBOR con i tassi *risk-free* sono disponibili al seguente link:

- Sito Mediobanca:
<https://www.mediobanca.com/it/regolamento-benchmark-ue-2016-1011-la-riforma-degli-ibors.html>.

Per qualsiasi richiesta di chiarimento può contattare la Sua persona di riferimento presso Mediobanca.

Cordiali saluti,

Mediobanca - Banca di
Credito Finanziario S.p.A.