



MEDIOBANCA

Banca di Credito Finanziario S.p.A.

MEDIOBANCA – BANCA DI CREDITO FINANZIARIO S.P.A.

Codice LEI (Legal entity identifier): PSQL19R2RXX5U3QWHI44

Società per Azioni, costituita ai sensi delle legge italiana, con sede legale in Piazzetta E.

Cuccia, 1 – 20121 – Milano (Italia)

Capitale Sociale: Euro 444.515.142,50

Partita IVA 10536040966

Iscritta al Registro delle Imprese di Milano, Monza, Brianza, Lodi: 00714490158

(l' "Emittente")

AVVISO DI EVENTO DI CREDITO

in relazione a:

Emissione fino a 1.000 Certificati "Zero Recovery Credit Securities legate ad un paniere di Entità di Riferimento con scadenza 20 dicembre 2024"

Numero di Serie: 716 - ISIN: XS2595642120

emesse dall'Emittente

a valere sul Programma di Emissione (Issuance Programme)

(i "Certificates")

Si informano i portatori dei Titoli, così come definiti sopra e regolati dalle Condizioni contenute nel Prospetto di Base datato 25 Maggio 2022 come supplementato tempo per tempo (il "Prospetto di Base"), ed completato dalle condizioni definitive datate 6 marzo 2023 (le "Condizioni Definitive").

I Certificates sono Titoli legati al Credito (*Credit Securities*), Titoli legati al Credito Zero Recovery (*Zero Recovery Credit Securities*), Titoli legati al Credito Basket (*Basket Credit Securities*) legati ad un paniere di Entità di Riferimento che comprende INTRUM AB ("INTRUM AB").

I termini utilizzati nel presente Avviso e non altrimenti definiti hanno il significato loro attribuito nella Documentazione d'Offerta dei Titoli.

Il presente avviso è reso ai sensi della Condizione del Titolo legato al Credito 12(d) (*Delivery of Notices*) per informare i portatori dei Titoli che l'Agente di Calcolo ha determinato, con riferimento a INTRUM AB, il verificarsi dell'evento di credito del fallimento (*Bankruptcy Credit Event*) e una Data di Determinazione dell'Evento (*Event Determination Date*) si è verificata relativamente a INTRUM AB.

L'Agente di Calcolo ha determinato quanto sopra sulla base di:

- (i) il comunicato stampa pubblicato il 15 novembre 2024 da INTRUM AB sul proprio sito web (https://www.intrum.com/press/press-releases/press-release-article/?id=a049dc1f-0cc1-44c3-b422-1425a0c492fb#Intrum_initiates_courtsupervised_process_in_the_US_to_implement_its_Recapitalisation_Transaction_having_received_overwhelming_support_from_creditors_for_its_prepackaged_Chapter_11_Reorganisation_Plan) (che costituisce un'informazione pubblicamente disponibile (*Publicly Available Information*) ai sensi delle Condizioni dei Titoli legati al Credito e, pertanto, il presente avviso costituisce anch'esso un Avviso di Informazione pubblicamente disponibile (*Notice of Publicly Available Information*)) con cui INTRUM AB ha informato il pubblico che in quella data



MEDIOBANCA

Banca di Credito Finanziario S.p.A.

ha presentato, presso il Tribunale Fallimentare degli Stati Uniti per il Distretto del Sud del Texas, un'istanza volontaria per l'attivazione di una procedura di ai sensi del Capitolo 11 (*Chapter 11 Filing*) del United States Bankruptcy Code; e

- (ii) la delibera adottata il 19 novembre 2024 dal Comitato per le Determinazioni dell'EMEA (*EMEA Determination Committee*) (che rappresenta il Comitato per le Determinazioni dei Derivati di Credito (*Credit Derivatives Determination Committee*) ai sensi delle Condizioni dei Titoli legati al Credito) ("**Delibera del Comitato per le Determinazioni dell'EMEA**" (*EMEA DC Resolution*)) con la quale il Comitato per le Determinazioni dell'EMEA ha:

- (a) preso atto e confermato il deposito dell'istanza ai sensi del Capitolo 11; e
- (b) determinato che (x) il deposito dell'istanza ai sensi del Capitolo 11 costituisce un "Evento di Credito (*Credit Event*)" ai sensi della Sezione 4.2(d) delle Definizioni del 2014 (*2014 Definitions*), avendo INTRUM AB avviato una procedura di insolvenza o fallimento e (y) la data in cui si è verificato tale Evento di Credito è il 15 Novembre 2024.

La Delibera del Comitato per le Determinazioni dell'EMEA costituisce una Comunicazione dell'Evento di Credito del Comitato per le Determinazioni (*DC Credit Event Announcement*) relativamente ai Certificates.

Alla luce di quanto sopra, con il presente avviso l'Emittente informa i portatori dei Certificates che l'Agente di Calcolo ha determinato quanto segue:

- (i) il deposito dell'istanza ai sensi del Capitolo 11 costituisce, relativamente ai Certificates, un Evento di Credito relativamente a INTRUM AB ai sensi della lettera (d) della definizione di Fallimento (*Bankruptcy*) contenuta nella Condizione dei Titoli legati al Credito 13 (*Definitions*),
- (ii) la data in cui tale Evento di Credito si è verificato, relativamente ai Certificates, è il 15 novembre 2024; e
- (iii) in relazione a tale Evento di Credito, la Data di Determinazione dell'Evento è il 18 novembre 2024 in quanto Data di Richiesta di Risoluzione dell'Evento di Credito (*Credit Event Resolution Request Date*) secondo la Delibera del Comitato per le Determinazioni dell'EMEA.

Trattandosi di Titoli legati al Credito Zero Recovery, la Condizione dei Titoli legati al Credito 2(b) non si applicherà e, pertanto, i portatori dei Certificates non riceveranno alcun pagamento o consegna come conseguenza dell'Evento di Credito e alla Data di Determinazione dell'Evento descritte nel presente avviso.

Ai sensi delle Condizioni dei Titoli legati al Credito e delle condizioni definitive, l'Importo Nozionale *Outstanding* per ciascun Certificate sarà ridotto della quota *pro rata* dell'Importo Nozionale dell'Entità di Riferimento INTRUM AB e, ai fini del calcolo degli importi di remunerazione sui Certificates e ai sensi della Condizione dei Titoli legati al Credito 3(a) (*Calculation of Remuneration Amount*), tale riduzione sarà effettiva a partire (e incluso) dalla Data di Determinazione dell'Evento come sopra indicata.

Milano, 28 Novembre 2024