

Informazione Regolamentata n. 0263-170-2015	Data/Ora Ricezione 04 Giugno 2015 18:45:49	MTA
---	--	-----

Societa' : UNICREDIT

Identificativo : 59369

Informazione
Regolamentata

Nome utilizzatore : UNICREDITN11 - Turconi

Tipologia : AVVI 16

Data/Ora Ricezione : 04 Giugno 2015 18:45:49

Data/Ora Inizio : 04 Giugno 2015 19:00:50

Diffusione presunta

Oggetto : Aggiornamento - Covered Warrant
UniCredit SpA su Banca Monte Paschi
Siena S.p.A.

Testo del comunicato

Vedi allegato.

Spett.le
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza degli Affari, 6
MILANO

4 giugno 2015

OGGETTO: Covered Warrant emessi da UniCredit S.p.A. con sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. – Aggiornamento

Facendo seguito all'avviso di Borsa Italiana n.9364 del 22 maggio 2015 relativo alla "Rettifica dei Covered Warrants emessi da UniCredit S.p.A. su Banca Monte dei Paschi di Siena a seguito di evento di natura straordinaria", si indicano di seguito i prossimi interventi previsti al fine di mantenere invariata, per quanto possibile, la posizione degli investitori in tali Covered Warrants:

- non saranno apportate ulteriori rettifiche alle caratteristiche dei Covered Warrants prima della scadenza del termine per l'esercizio dei diritti di opzione, previsto il 12 giugno 2015

- in data 12 giugno 2015 dopo la chiusura del mercato, le caratteristiche dei Covered Warrants saranno rettificate (i) sostituendo il sottostante rappresentato da un paniere costituito da un'azione Banca Monte dei Paschi di Siena (IT0005092165) e da un diritto di opzione (IT0005091993) con una singola azione Banca Monte Paschi di Siena (IT0005092165) e (ii) modificando Strike e Multiplo sulla base di un coefficiente di rettifica K. Le modalità di determinazione del coefficiente di rettifica K saranno comunicate tramite uno specifico avviso entro il secondo giorno di borsa aperta antecedente la data di efficacia di tale rettifica (entro 11 giugno 2015).

A partire dal 9 giugno 2015 e fino al 12 giugno 2015, l'operatore specialista, UniCredit Bank AG Milan Branch, utilizzerà per la determinazione delle proposte in acquisto e vendita aventi a oggetto Covered Warrants, una valorizzazione fissa dei diritti di opzione basata sull'ultimo prezzo di mercato del 8 giugno 2015.

Si segnala inoltre che l'eventuale modifica delle condizioni e/o del calendario dell'offerta come descritte negli avvisi di Borsa Italiana n. 8608 del 14.05.2015, n. 9290 del 21.05.2015 e n.9353 del 22.05.2015) potrà richiedere ulteriori rettifiche alle caratteristiche dei Covered Warrants al fine di mantenere invariata, per quanto possibile, la posizione degli investitori in tali Covered Warrant.

- **Elenco dei Covered Warrant interessati:** si veda in allegato la Tabella 1

UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
20121 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.it

UniCredit S.p.A. - Sede Sociale: ROMA Via
A. Specchi, 16- Direzione Generale: MILANO
Piazza Cordusio, iscrizione al Registro delle
Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA
n° 00348170101, iscritta all'Albo delle Banche
e capogruppo del Gruppo Bancario UniCredit,
Albo dei Gruppi Bancari: cod.3135.1 -
Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei
Depositi - capitale sociale €
19.654.856.199,43, interamente versato.

Tabella 1:

Codice ISIN	Tipologia	Call/ Put	Sottostante	Strike	Multiplo	Scadenza
IT0005065062	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	24	0.005	04/09/2015
IT0005065161	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	18	0.005	04/12/2015
IT0005051484	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	30	0.005	04/09/2015
IT0005051526	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	26	0.005	04/12/2015
IT0005051534	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	28	0.005	04/12/2015
IT0005065187	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	20	0.005	04/12/2015
IT0005051468	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	26	0.005	04/09/2015
IT0005051575	Covered Warrant	Put	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	20	0.005	04/12/2015
IT0005065005	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	20	0.005	04/09/2015

Cordiali saluti,
UniCredit S.p.A.

UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
20121 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.it

UniCredit S.p.A. - Sede Sociale: ROMA Via
A. Specchi, 16- Direzione Generale: MILANO
Piazza Cordusio, iscrizione al Registro delle
Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA
n° 00348170101, iscritta all'Albo delle Banche
e capogruppo del Gruppo Bancario UniCredit,
Albo dei Gruppi Bancari: cod.3135.1 -
Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei
Depositi - capitale sociale €
19.654.856.199,43, interamente versato.

Fine Comunicato n.0263-170

Numero di Pagine: 4