

Informazione Regolamentata n. 0263-183-2015	Data/Ora Ricezione 11 Giugno 2015 18:24:33	MTA
---	--	-----

Societa' : UNICREDIT
Identificativo : 59643
Informazione
Regolamentata
Nome utilizzatore : UNICREDITN11 - Rathnow
Tipologia : AVVI 16
Data/Ora Ricezione : 11 Giugno 2015 18:24:33
Data/Ora Inizio : 11 Giugno 2015 18:39:33
Diffusione presunta
Oggetto : Rettifica Covered Warrant UniCredit SpA
con sottostante Banca Monte Paschi Siena

Testo del comunicato

Vedi allegato.

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

11 giugno 2015

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

Facendo seguito all'avviso di Borsa Italiana n.10065 del 5 giugno 2015 relativo all' "Aggiornamento - Covered Warrants UniCredit S.p.A. su Banca Monte Paschi Siena", si indicano di seguito le modalità di determinazione del coefficiente di rettifica K applicate al fine di mantenere invariata, per quanto possibile, la posizione degli investitori in tali Covered Warrants.

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 pari a 0.203463 comunicato dal mercato IDEM (si veda l'avviso di Borsa Italiana n. 9365 del 22 maggio 2015).

Si ricorda che 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.

- **Data di efficacia:** 15/06/2015
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** IT0005092165
- **Coefficiente di rettifica:** **0.203463**
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Caratteristiche dei Covered Warrant ante e post rettifica in forma tabellare:** si veda in allegato la Tabella

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	Precedente Sottostante	Nuovo Sottostante	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Multiplo	Nuovo Multiplo	Scadenza
IT0005065062	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	24	4,8831	0,005	0,0246	04/09/2015
IT0005065161	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	18	3,6623	0,005	0,0246	04/12/2015
IT0005051484	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	30	6,1039	0,005	0,0246	04/09/2015
IT0005051526	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	26	5,2900	0,005	0,0246	04/12/2015
IT0005051534	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	28	5,6970	0,005	0,0246	04/12/2015
IT0005065187	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	20	4,0693	0,005	0,0246	04/12/2015
IT0005051468	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	26	5,2900	0,005	0,0246	04/09/2015
IT0005051575	Covered Warrant	Put	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	20	4,0693	0,005	0,0246	04/12/2015
IT0005065005	Covered Warrant	Call	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	20	4,0693	0,005	0,0246	04/09/2015

Data di efficacia della rettifica: 15/06/2015

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.0263-183

Numero di Pagine: 4