

Bit Market Services

Informazione Regolamentata n. 0263-275-2015	Data/Ora Ricezione 17 Settembre 2015 13:55:24	MTA
---	---	-----

Societa' : UNICREDIT
Identificativo : 63223
Informazione
Regolamentata
Nome utilizzatore : UNICREDITN11 - Turconi
Tipologia : AVVI 16
Data/Ora Ricezione : 17 Settembre 2015 13:55:24
Data/Ora Inizio : 17 Settembre 2015 14:10:25
Diffusione presunta
Oggetto : Avviso Covered Warrant su World Duty
Free di UniCredit

Testo del comunicato

Vedi allegato.

Spettabile
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza Affari, 6
20123 Milano

Milano, 17 settembre 2015

OGGETTO: EVENTO RILEVANTE CON POSSIBILE SCADENZA ANTICIPATA DEI COVERED WARRANT CON SOTTOSTANTE WORLD DUTY FREE S.P.A. (IT0004954662) EMESSI DA UNICREDIT S.P.A. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

- **Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:**

L'offerta pubblica di acquisto obbligatoria totalitaria sulle azioni ordinarie World Duty Free S.p.A. promossa da Dufry Financial Services BV ha oggetto la totalità delle azioni in circolazione di World Duty Free S.p.A..

Nel caso in cui al termine del periodo di offerta, alla chiusura delle negoziazioni del 9 Ottobre 2015, l'offerente verrà a detenere una partecipazione superiore al 90%, tutti i contratti di opzione su azioni World Duty Free S.p.A. verranno chiusi e liquidati applicando la metodologia del Theoretical Fair Value (si veda avviso IDEM n. 15475 del 14 settembre 2015).

Tali fatti, se verificati, costituiscono **Evento Rilevante** ai sensi dell'articolo 2.2.3 del Prospetto di Base relativo al Programma di offerta e quotazione di Covered Warrant di UniCredit S.p.A. depositato presso la CONSOB in data 27 luglio 2015, a seguito di approvazione comunicata con nota n. 0059563/15 del 23 luglio 2015.

UniCredit S.p.A., Emittente dei Covered Warrant con sottostante World Duty Free S.p.A. elencati in Tabella 1 (i "Covered Warrant"), in accordo con l'Agente per il Calcolo, ai sensi dell'articolo 2.2.3.3 del Prospetto di Base, informa i portatori dei **Covered Warrant** che essi **scadranno anticipatamente, subordinatamente all'esito dell'offerta pubblica di acquisto totalitaria, il cui termine è previsto per il 9 Ottobre 2015**. Seguirà ulteriore comunicazione in seguito alla chiusura del periodo di offerta.

UniCredit Bank AG, in qualità di Specialista dei Covered Warrant, ha richiesto a Borsa Italiana la possibilità di esporre quote in solo acquisto con efficacia a partire dal 16 settembre 2015 (si veda avviso di Borsa Italiana n.15550 del 15 settembre 2015).

In caso di scadenza anticipata dei Covered Warrant, ai sensi dell'articolo 2.2.3.3 paragrafo 4 del Prospetto di Base, l'Agente per il Calcolo determinerà l'Importo di Liquidazione, che sarà liquidato dall'Agente per il Pagamento, dei Covered Warrant sulla base di un Prezzo di Riferimento calcolato secondo la migliore prassi internazionale in buona fede nonché in considerazione di ogni informazione e/o elemento ritenuto utile dall'Agente per il Calcolo e avrà in particolare la facoltà ma non l'obbligo di utilizzare il prezzo di liquidazione del Sottostante impiegato dal corrispondente Mercato Correlato, ove applicabile.

UniCredit S.p.A.

Piazza Gae Aulenti, 3
20124 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 Gae Aulenti 3 - Tower A, 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 € 19.905.773.742,24, interamente versato.

In caso di scadenza anticipata dei Covered Warrant, sulla base delle informazioni attualmente disponibili e fermo restando la possibilità di ulteriori aggiustamenti, verrà applicata la metodologia del Theoretical Fair Value (TFV) analogamente a quanto applicato dal relativo Mercato Correlato IDEM. Tale metodologia tiene in considerazione le seguenti variabili:

Data di Valutazione: chiusura del periodo di offerta (ad oggi previsto il 9 Ottobre 2015)

Prezzo di Riferimento: “prezzo di riferimento” del Sottostante alla Data di Valutazione, fatto salvo il verificarsi di un Evento di Turbativa

Tassi di interesse: tasso di interesse basato sulla curva Euribor, coerente con la vita residua del contratto, rilevato nel giorno antecedente la chiusura e liquidazione dei contratti di opzione.

Dividendi attesi: nulli (fonte: Bloomberg)

Volatilità: a differenza del Mercato Correlato IDEM, ai fini del calcolo del TFV si utilizza la volatilità implicita dei singoli Covered Warrant rilevata alla Data di Valutazione

Data di Pagamento: cinque giorni bancari successivi alla Data di Valutazione (indicativamente il 16 ottobre 2015)

Tabella 1:

Codice ISIN	Tipologia	Call/Put	Sottostante	Strike	Scadenza
IT0005065211	Covered Warrant	Call	World Duty Free S.p.A.	6	04/12/2015
IT0005065237	Covered Warrant	Call	World Duty Free S.p.A.	8	04/12/2015
IT0005081887	Covered Warrant	Call	World Duty Free S.p.A.	10	04/12/2015
IT0005081895	Covered Warrant	Call	World Duty Free S.p.A.	12	04/12/2015
IT0005065252	Covered Warrant	Put	World Duty Free S.p.A.	6	04/12/2015
IT0005081903	Covered Warrant	Put	World Duty Free S.p.A.	8	04/12/2015
IT0005081911	Covered Warrant	Put	World Duty Free S.p.A.	10	04/12/2015

- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** World Duty Free S.p.A. (ISIN IT0004954662)
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM

Cordiali saluti,

UniCredit SpA

UniCredit S.p.A.

Piazza Gae Aulenti, 3
20124 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 Gae Aulenti 3 - Tower A, 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 € 19.905.773.742,24, interamente versato.

Fine Comunicato n.0263-275

Numero di Pagine: 4