

Bit Market Services

Informazione Regolamentata n. 0263-302-2015	Data/Ora Ricezione 09 Ottobre 2015 19:10:30	MTA
---	---	-----

Societa' : UNICREDIT

Identificativo : 64106

Informazione
Regolamentata

Nome utilizzatore : UNICREDITN11 - Turconi

Tipologia : AVVI 16

Data/Ora Ricezione : 09 Ottobre 2015 19:10:30

Data/Ora Inizio : 09 Ottobre 2015 19:25:31

Diffusione presunta

Oggetto : Scadenza Anticipata Covered Warrant su
World Duty Free di UniCredit SpA a seguito
di Evento Rilevante

Testo del comunicato

Vedi allegato.

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

Milano, 9 ottobre 2015

OGGETTO: 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:**

Con riferimento a:

- avviso di UniCredit S.p.A. con 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", pubblicato da Borsa Italiana con avviso n. 15666 in data 17 settembre 2015
- **avviso IDEM n. 16953 del 9 ottobre 2015 e avviso di Borsa Italiana n. 16952 del 9 ottobre 2015**
- avviso IDEM n. 15475 del 14 settembre 2015 e avvisi di Borsa Italiana n. 15258 del 9 settembre 2015, n. 15379 del 11 settembre 2015 e n. 15645 del 17 settembre 2015

in seguito a:

- esito dell'offerta pubblica di acquisto obbligatoria totalitaria sulle azioni ordinarie World Duty Free S.p.A. promossa da Dufry Financial Services, con il raggiungimento in data odierna da parte dell'offerente della soglia di partecipazione superiore al 90%
- relativa chiusura e liquidazione dei contratti di opzione su World Duty Free S.p.A. al termine delle negoziazioni del 9 ottobre 2015
- venir meno dei requisiti di liquidità delle azioni World Duty Free S.p.A.

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.

UniCredit S.p.A.

in qualità di 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, conferma ai portatori dei **Covered Warrant** che essi **scadono anticipatamente e si estingueranno a far data dal 12 ottobre 2015**.

Come annunciato in data 17 settembre 2015, per il calcolo dell'Importo di liquidazione dei Covered Warrant 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 (9 Ottobre 2015)

Prezzo di Riferimento: "prezzo di riferimento" del Sottostante alla Data di Valutazione

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 (16 ottobre 2015)

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.

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

Legale rappresentante

Legale rappresentante





UniCredit S.p.A.Piazza Gae Aulenti, 3
20124 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.itUniCredit 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.0263-302

Numero di Pagine: 5