

# Bit Market Services

|   |  |     |
|---|--|-----|
| Informazione<br>Regolamentata n.<br>0263-144-2016 | Data/Ora Ricezione<br>03 Giugno 2016<br>18:05:46 | MTA |
|---|--|-----|

Societa' : UNICREDIT  
Identificativo : 75249  
Informazione  
Regolamentata  
Nome utilizzatore : UNICREDITN11 - Rathnow  
Tipologia : AVVI 16  
Data/Ora Ricezione : 03 Giugno 2016 18:05:46  
Data/Ora Inizio : 03 Giugno 2016 18:20:46  
Diffusione presunta  
Oggetto : Rettifica di Covered Warrants con  
sottostante Banco Popolare emessi da  
UniCredit SpA

*Testo del comunicato*

Vedi allegato.

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

Milano, 3 giugno 2016

**OGGETTO: RETTIFICA DI COVERED WARRANT EMESSI DA UNICREDIT S.P.A. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA**

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

Banco Popolare S.p.A. ha reso noto l'aumento di capitale a pagamento. Il Consiglio di Amministrazione ha deliberato l'emissione di n. 465.581.304 nuove azioni prive di indicazione del valore nominale, aventi le medesime caratteristiche delle azioni ordinarie già in circolazione e godimento regolare, da offrire in opzione agli azionisti della Società nel rapporto di n.9 Azioni Banco Popolare ogni n. 7 azioni possedute, al prezzo di sottoscrizione di Euro 2.14 per ciascuna azione Banco Popolare. I diritti di opzione potranno essere esercitati a partire dal 6 giugno 2016 (si veda l'Avviso di Borsa Italiana n.11100 del 2 giugno 2016 e n. 11201 del 3 giugno 2016, gli avvisi IDEM n. 11170 e 11171 del 2 giugno 2016 e avviso IDEM n. 11210 del 3 giugno 2016).

Al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Covered Warrant emessi da UniCredit S.p.A., con efficacia a partire dall'inizio delle negoziazioni del 6 giugno 2016, in linea con le modalità di rettifica del mercato dei derivati IDEM, i valori di Strike e Multiplo vengono rettificati come indicato in Tabella 1, in base al coefficiente di rettifica determinato e pubblicato da IDEM al termine delle contrattazioni in data 3 giugno 2016 pari a 0.741939.

Tali rettifiche sono efficaci dal 6 giugno 2016.

- **Data di efficacia:** 6 giugno 2016
- **Coefficiente di rettifica:** 0.741939
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** IT0005002883
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Caratteristiche dei certificates/cw ante e post rettifica in forma tabellare:**  
si veda Tabella 1

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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:**

| ISIN         | Tipologia       | Sottostante           | Call/Put | Scadenza   | Precedente Strike | Nuovo Strike | Precedente Multiplo | Nuovo Multiplo |
|--------------|-----------------|-----------------------|----------|------------|-------------------|--------------|---------------------|----------------|
| IT0005180481 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 6                 | 4.4516       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005180507 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 6.5               | 4.8226       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005180523 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 7                 | 5.1936       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005180549 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 7.5               | 5.5645       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166795 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 8                 | 5.9355       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005180564 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 8.5               | 6.3065       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166811 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 9                 | 6.6775       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166837 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 10                | 7.4194       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166852 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 11                | 8.1613       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166878 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 12                | 8.9033       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005148090 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 13                | 9.6452       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005148116 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 15                | 11.1291      | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005148132 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 16/06/2016 | 17                | 12.613       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166894 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put      | 16/06/2016 | 5                 | 3.7097       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166910 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put      | 16/06/2016 | 6                 | 4.4516       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166936 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put      | 16/06/2016 | 7                 | 5.1936       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166951 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put      | 16/06/2016 | 8                 | 5.9355       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166977 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put      | 16/06/2016 | 9                 | 6.6775       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005148157 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put      | 16/06/2016 | 10                | 7.4194       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005180580 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 15/09/2016 | 6                 | 4.4516       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005180606 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 15/09/2016 | 7                 | 5.1936       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005166993 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 15/09/2016 | 8                 | 5.9355       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005180622 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 15/09/2016 | 9                 | 6.6775       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005167017 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 15/09/2016 | 10                | 7.4194       | 0.1                 | 0.1348         |
| IT0005167033 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call     | 15/09/2016 | 12                | 8.9033       | 0.1                 | 0.1348         |

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.



|              |                 |                       |      |            |    |         |     |        |
|--------------|-----------------|-----------------------|------|------------|----|---------|-----|--------|
| IT0005148173 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/09/2016 | 14 | 10.3871 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005131336 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/09/2016 | 16 | 11.871  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005131351 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/09/2016 | 18 | 13.3549 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005131377 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/09/2016 | 20 | 14.8388 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005131393 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/09/2016 | 22 | 16.3227 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180648 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/09/2016 | 4  | 2.9678  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005167058 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/09/2016 | 6  | 4.4516  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005167074 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/09/2016 | 8  | 5.9355  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005148199 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/09/2016 | 10 | 7.4194  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005131419 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/09/2016 | 12 | 8.9033  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005131435 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/09/2016 | 14 | 10.3871 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005131450 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/09/2016 | 16 | 11.871  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180663 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/12/2016 | 6  | 4.4516  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005167090 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/12/2016 | 8  | 5.9355  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005167116 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/12/2016 | 10 | 7.4194  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005167132 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/12/2016 | 12 | 8.9033  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005148215 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/12/2016 | 14 | 10.3871 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005148231 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/12/2016 | 16 | 11.871  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005148256 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 15/12/2016 | 18 | 13.3549 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180689 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/12/2016 | 4  | 2.9678  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005167157 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/12/2016 | 6  | 4.4516  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005167173 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/12/2016 | 8  | 5.9355  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005148272 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/12/2016 | 10 | 7.4194  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005148298 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/12/2016 | 12 | 8.9033  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005148314 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 15/12/2016 | 14 | 10.3871 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180705 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 16/03/2017 | 6  | 4.4516  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180721 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 16/03/2017 | 8  | 5.9355  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180747 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Call | 16/03/2017 | 10 | 7.4194  | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180762 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put  | 16/03/2017 | 4  | 2.9678  | 0.1 | 0.1348 |

**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.



|              |                 |                       |     |            |   |        |     |        |
|--------------|-----------------|-----------------------|-----|------------|---|--------|-----|--------|
| IT0005180788 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put | 16/03/2017 | 6 | 4.4516 | 0.1 | 0.1348 |
| IT0005180804 | Covered Warrant | Banco Popolare S.p.A. | Put | 16/03/2017 | 8 | 5.9355 | 0.1 | 0.1348 |

Data di efficacia della rettifica: 6 giugno 2016

Cordiali saluti,  
**UniCredit S.p.A.**

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.0263-144

Numero di Pagine: 6