



Borsa Italiana

AVVISO n.5066	28 Marzo 2014	SeDeX - INV. CERTIFICATES
--------------------------	---------------	------------------------------

Mittente del comunicato : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE

Societa' oggetto : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
dell'Avviso

Oggetto : Certificate - Rettifiche

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 31/3/2014 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza



BNP PARIBAS

Milano, 28/03/2014

OGGETTO: RETTIFICA DI INVESTMENT CERTIFICATE (NL0010398020) EMESSE DA BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE B.V. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

- **Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:** Operazione di aumento del capitale sociale da parte di Banco Popolare (codice Isin: IT0005002883), mediante offerta in opzione di diritti di sottoscrizione di n° 17 nuove azioni ogni n° 18 azioni possedute, ad un prezzo di sottoscrizione di 9 euro per azione (si veda l'avviso 4857 del 27 marzo 2014 e l'avviso 4977 del 28 marzo 2014).
- **Data di efficacia** 31/03/2014
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** IT0005002883
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Rettifica:**

La società BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. in qualità di emittente di Investment Certificate, sulla base di quanto descritto all'interno del Regolamento dei Covered Warrant e degli Investment Certificate, nel tempo modificato e aggiornato, intende rettificare l' Investment Certificate su azioni Banco Popolare (codice ISIN NL0010398020), quotati sul mercato Sedex di Borsa Italiana S.P.A., in conformità alle modalità di rettifica adottate dal mercato IDEM (si veda la avviso 4862 del 27 marzo 2014) attraverso una modifica dei valori di riferimento del Certificate in base al coefficiente di rettifica **K**, secondo quanto riportato in Tabella 1 (in allegato).

Viene calcolato un coefficiente di rettifica **K** calcolato al termine delle negoziazioni della giornata del 28 marzo 2014, ottenuto con la seguente formula :

$$K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}} = 0,757143$$

- P_{ex} = prezzo "ex diritto"
- P_{cum} = prezzo "cum diritto"

ALLEGATI

Tabella 1: Rettifica Investment Certificate con sottostante Banco Popolare

<i>ISIN</i>	<i>Tipologia di prodotto</i>	<i>Sottostante</i>	<i>Strike price Ante rettifica</i>	<i>Strike price Post rettifica</i>	<i>Knock-out Level Ante rettifica</i>	<i>Knock-out Level Post rettifica</i>	<i>Cap Level Ante rettifica</i>	<i>Cap Level Post rettifica</i>	<i>Scadenza</i>
NL0010398020	Bonus Cap	Banco Popolare	9.0500 EUR	6.8521 EUR	5.8825 EUR	4.4539 EUR	10.5433 EUR	7.9828 EUR	18/07/2014

- DATA DI EFFICACIA DELLA RETTIFICA 31/03/2014