



AVVISO n.12027	27 Giugno 2014	SeDeX
---------------------------	----------------	-------

Mittente del comunicato : SOCIETE GENERALE
Societa' oggetto : SG ISSUER
dell'Avviso : SOCIETE GENERALE
Oggetto : Rettifica strumenti emessi da SG e SGIS
con sottostante Banca Monte dei Paschi di
Siena

Testo del comunicato

Si veda l'avviso n.11500 del 20/6/2014.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 30/6/2014 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

Milano, 27/06/2014

Oggetto: Rettifica strumenti emessi da SG e SGS con sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena

Si fa seguito comunicato riportato nell'Avviso N. 11500 del 20/06/2014, qui di seguito allegato, nel quale tra l'altro si descrivevano le modalità di rettifica dei covered warrants e dei certificate emessi da SG e SGS con sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena con efficacia dal 30/06/2014, rinviando ad un successivo avviso la comunicazione del valore del coefficiente di rettifica e dei valori conseguentemente rettificati.

Société Générale comunica, con il presente Avviso, che il coefficiente di rettifica K è pari a 0.065801

Qui di seguito vengono riportati, relativamente ai covered warrants e ai certificate emessi da SG e SGS con sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena, i valori rettificati rispettivamente di strikes e parità, nonché, per il certificate, di barriera e valore iniziale del sottostante, con efficacia dal 30/06/2014.

Covered Warrant con emittente Société Générale

Isin Code	Underlying	Old Strike	New Strike	Old Parity	New Parity
FR0011765593	BANCA MONTE PASCHI SIENA	30	1.9740	0.001	0.0152
FR0011396324	BANCA MONTE PASCHI SIENA	40	2.6320	0.001	0.0152
FR0011765619	BANCA MONTE PASCHI SIENA	60	3.9481	0.001	0.0152
FR0011396613	BANCA MONTE PASCHI SIENA	60	3.9481	0.001	0.0152
FR0011396811	BANCA MONTE PASCHI SIENA	20	1.3160	0.001	0.0152
FR0011932912	BANCA MONTE PASCHI SIENA	24	1.5792	0.1	1.5197
FR0011932979	BANCA MONTE PASCHI SIENA	26	1.7108	0.1	1.5197
FR0011932938	BANCA MONTE PASCHI SIENA	28	1.8424	0.1	1.5197
FR0011932995	BANCA MONTE PASCHI SIENA	30	1.9740	0.1	1.5197
FR0011933001	BANCA MONTE PASCHI SIENA	20	1.3160	0.1	1.5197
FR0011932961	BANCA MONTE PASCHI SIENA	22	1.4476	0.1	1.5197
FR0011932946	BANCA MONTE PASCHI SIENA	22	1.4476	0.1	1.5197

Bonus Cap Certificate con emittente SG Issuer e Calculation Agent Société Générale

Isin Code	Underlying	Old S(0) (*)	New S(0) (*)	Old Low Barrier	New Low Barrier
LU1017641256	BANCA MONTE PASCHI SIENA	18.1	1.191	11	0.7238

(*) Valore iniziale del sottostante.

Cordiali saluti,

Société Générale

Milano, 20/06/2014

Oggetto: Rettifica strumenti emessi da SG e SGIS con sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena

Facendo seguito all'Avviso N. 10758 del 10/06/2014 relativo alla rettifica dei covered warrants e del certificate emessi da SG e SGIS con sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena (i "**Prodotti SG**"), nel quale tra l'altro Société Générale aveva anticipato che i Prodotti SG sarebbero stati oggetto di successiva rettifica, Société Générale riporta qui di seguito gli interventi previsti in relazione alla fine delle contrattazioni e alla successiva scadenza dei diritti di acquisto delle nuove azioni Banca Monte dei Paschi di Siena.

A partire dal 23/06/2014 (data in cui cesserà la negoziazione dei diritti di opzione) e sino al 27/06/2014 (inclusi), il diritto di acquisto di 42,8 azioni Banca Monte Paschi al prezzo di 1 € l'una, incluso nel basket sottostante i Prodotti SG, sarà valorizzato come pari al prezzo di riferimento del 20/06/2014, così come rilevato e pubblicato da Borsa Italiana.

Con efficacia dal 30/06/2014 (primo giorno di Borsa aperta dopo la data di scadenza dei diritti di opzione), Société Générale rettificherà i Prodotti SG come segue:

- sostituendo l'attuale basket sottostante i Prodotti SG con 1 azione Banca Monte Paschi Siena;
- rettificando, gli strike prices e le parità per i covered warrants, la barriera e il valore iniziale del sottostante per il certificate, mediante l'applicazione di un coefficiente K, calcolato secondo la seguente formula e arrotondato alla sesta cifra decimale:

$$K = \text{Prezzo BMPS} / \text{Prezzo Basket}$$

Dove:

Prezzo BMPS = Prezzo di riferimento del 27/06/2014 dell'azione Banca Monte Paschi Siena;

Prezzo Basket = (Prezzo di riferimento del 20/06/2014 del diritto di acquisto di 42,8 azioni Banca Monte Paschi al prezzo di 1 € l'una + Prezzo di riferimento del 27/06/2014 dell'azione Banca Monte Paschi Siena).

In particolare:

- Con riferimento ai covered warrants, gli strike prices verranno moltiplicati per il coefficiente K e le Parità verranno divise per il coefficiente K. I valori così ottenuti saranno arrotondati alla 4 cifra decimale;
- Con riferimento al certificate, sia la barriera ("Low Barrier" come definita nei Final Terms che disciplinano il prodotto) che il valore del Sottostante alla data di valutazione iniziale ("S(0)" come definito nei Final Terms che disciplinano il prodotto), saranno moltiplicati per il coefficiente K. I valori così ottenuti saranno arrotondati alla 4 cifra decimale.

Si precisa che, relativamente ai Prodotti SG, i valori rettificati di strikes, parità, barriera e valore iniziale del sottostante saranno comunicati alla chiusura del mercato del 27/06/2014.

Qui di seguito i codici ISIN degli strumenti interessati da questi interventi:

Covered Warrant con emittente Société Générale

Isin Code
FR0011765593
FR0011396324
FR0011932995
FR0011765619
FR0011396613
FR0011396811
FR0011932912
FR0011932979
FR0011932938
FR0011933001
FR0011932961
FR0011932946

Bonus Cap Certificate con emittente SG Issuer e Calculation Agent Société Générale

Isin Code
LU1017641256

I covered warrants con codice ISIN FR0011396050, FR0011396266 e FR0011395995, seppur oggetto del precedente Avviso, non subiranno la rettifica sopra riportata poiché scadono in data odierna, 20/06/2014.

Cordiali saluti,

Société Générale