

AVVISO n.19714

18 Novembre 2011

**SeDeX – PLAIN
VANILLA**

Mittente del comunicato : UNICREDIT
Societa' oggetto dell'Avviso : UNICREDIT
Oggetto : Securitised Derivatives – Rettifica Strike Price e Parità

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 21/11/2011 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza

Spett.le
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza degli Affari, 6
MILANO

Milano, 18.11.2011

Oggetto: avviso di rettifica di Covered Warrant legati alle azioni A2A (IT0001233417) emessi da UniCredit in seguito alla distribuzione di un dividendo straordinario.

A seguito della distribuzione di un dividendo straordinario pari a 0,036€ per azione ai detentori di azioni ordinarie A2A con codice ISIN IT0001233417, si vedano Avvisi di Borsa n. 5125 del 30 marzo 2011, n. 10620 del 16 Giugno 2011 e n. 19493 del 15 Novembre 2011. UniCredit in qualità di emittente di Covered Warrant, sulla base di quanto previsto dal regolamento degli stessi, intende rettificare, in conformità alle modalità di rettifica previste dal mercato IDEM, si veda avviso IDEM n. 19495 del 15 Novembre 2011, i Covered Warrant emessi da UniCredit sulle azioni A2A al fine di mantenere invariata la posizione finanziaria dei portatori di tali titoli.

Pertanto, a partire dal 21.11.2011:

- gli strike dei Covered Warrant di UniCredit su A2A saranno rettificati moltiplicando i valori correnti per il coefficiente di rettifica K, come determinato dal mercato IDEM, mentre il multiplo di tutti gli strumenti sarà diviso per il coefficiente di rettifica K, con K pari a:

$$\text{Coefficiente di rettifica } K = 0,957219$$

Nella tabella 1 sono riportate le caratteristiche dei Covered Warrant aggiornate a seguito della rettifica. Gli effetti della rettifica saranno efficaci a partire dal 21.11.2011.

Distinti saluti,

UniCredit S.p.A.

UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
20121 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 Cordusio, 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 € 9.649.245.346,50, interamente versato.

Tabella 1 – Covered Warrant di UniCredit

ISIN	Sottostante	ISIN Sottostante	Tipo	Strike	Nuovo Strike	Multiplo	Nuovo Multiplo	Scadenza
IT0004730062	A2A	IT0001233417	Call	1.2	1.1487	0.1	0.1045	02.12.2011
IT0004730070	A2A	IT0001233417	Call	1.35	1.2922	0.1	0.1045	02.12.2011
IT0004730088	A2A	IT0001233417	Put	1.1	1.0529	0.1	0.1045	02.12.2011
IT0004740491	A2A	IT0001233417	Call	1.05	1.0051	0.1	0.1045	02.12.2011
IT0004740509	A2A	IT0001233417	Put	0.95	0.9094	0.1	0.1045	02.12.2011
IT0004740517	A2A	IT0001233417	Call	1	0.9572	0.1	0.1045	02.03.2012
IT0004740525	A2A	IT0001233417	Call	1.15	1.1008	0.1	0.1045	02.03.2012
IT0004740533	A2A	IT0001233417	Call	1.3	1.2444	0.1	0.1045	02.03.2012
IT0004740541	A2A	IT0001233417	Put	1	0.9572	0.1	0.1045	02.03.2012
IT0004740558	A2A	IT0001233417	Put	0.85	0.8136	0.1	0.1045	02.03.2012
IT0004756356	A2A	IT0001233417	Call	0.9	0.8615	0.1	0.1045	02.12.2011
IT0004756364	A2A	IT0001233417	Put	0.8	0.7658	0.1	0.1045	02.12.2011
IT0004756372	A2A	IT0001233417	Call	0.85	0.8136	0.1	0.1045	02.03.2012
IT0004756380	A2A	IT0001233417	Put	0.75	0.7179	0.1	0.1045	02.03.2012
IT0004768310	A2A	IT0001233417	Call	0.9	0.8615	0.1	0.1045	01.06.2012
IT0004768328	A2A	IT0001233417	Call	1.1	1.0529	0.1	0.1045	01.06.2012
IT0004768336	A2A	IT0001233417	Call	1.35	1.2922	0.1	0.1045	01.06.2012
IT0004768344	A2A	IT0001233417	Put	0.8	0.7658	0.1	0.1045	01.06.2012

UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
20121 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 Cordusio, 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 € 9.649.245.346,50, interamente versato.