

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

22 maggio 2015

**OGGETTO: RETTIFICA DI COVERED WARRANT EMESSI DA UNICREDIT SpA A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA**

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

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. ("MONTEPASCHI") ha annunciato in data 21 maggio 2015 l'aumento a pagamento del capitale sociale, deliberato dall'Assemblea dei soci del 16 aprile 2015 (si vedano gli Avvisi di Borsa Italiana n. 8608 del 14 maggio 2015, n. 9290 del 21 maggio 2015 e n. 9353 del 22 maggio 2015, gli Avvisi IDEM n. 8637 del 14 maggio 2015 e IDEM n. 9296 del 21 maggio 2015).

In particolare il Consiglio di Amministrazione di MONTEPASCHI ha deliberato di emettere massime 2.558.256.930 azioni ordinarie MONTEPASCHI di nuova emissione, senza indicazione del valore nominale, aventi le stesse caratteristiche delle azioni MONTEPASCHI in circolazione, incluso il godimento regolare, da offrire in opzione ai soggetti titolari di azioni MONTEPASCHI al prezzo di sottoscrizione pari a Euro 1,17 per ciascuna nuova azione MONTEPASCHI, da imputarsi interamente a capitale, nel rapporto di 10 (dieci) azioni di nuova emissione MONTEPASCHI per ciascuna azione MONTEPASCHI posseduta.

Di conseguenza, al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori, i Covered Warrant con sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. emessi da UniCredit S.p.A. verranno rettificati a partire dal 25.05.2015 attraverso la sostituzione del sottostante con un paniere composto da:

- n. 1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.
- n. 1 diritto di opzione

Alla scadenza dei diritti, seguirà ulteriore rettifica al paniere sottostante, come da successivo comunicato.

- **Data di efficacia:** 25/05/2015
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** IT0005092165
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Caratteristiche dei Covered Warrant ante e post rettifica in forma tabellare:** si veda in allegato la Tabella 1

**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 € 19.654.856.199,43, interamente versato.

Tabella 1:

Codice ISIN	Tipologia	Call/ Put	Sottostante	Nuovo Sottostante	Strike	Multiplo	Scadenza
IT0005051443	Covered Warrant	Put	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	20	0.005	05/06/2015
IT0005064768	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	21	0.005	05/06/2015
IT0005065062	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	24	0.005	04/09/2015
IT0005065161	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	18	0.005	04/12/2015
IT0005051484	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	30	0.005	04/09/2015
IT0005051526	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	26	0.005	04/12/2015
IT0005051401	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	24	0.005	05/06/2015
IT0005051435	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	30	0.005	05/06/2015
IT0005051534	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	28	0.005	04/12/2015
IT0005065187	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	20	0.005	04/12/2015
IT0005051468	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	26	0.005	04/09/2015
IT0005051575	Covered Warrant	Put	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	20	0.005	04/12/2015
IT0005064842	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	23	0.005	05/06/2015
IT0005065005	Covered Warrant	Call	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.	1 azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. + 1 diritto d'opzione	20	0.005	04/09/2015

**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 €  
19.654.856.199,43, interamente versato.



Data di efficacia della rettifica 25/05/2015

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

**UniCredit S.p.A.**

Via San Protaso, 3  
20121 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 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 €  
19.654.856.199,43, interamente versato.