

AVVISO n.14856

25 Settembre 2009

**SeDeX – INV.
CERTIFICATES**

Mittente del comunicato : ABAXBANK
Societa' oggetto : ABAXBANK
dell'Avviso
Oggetto : Certificates – Rettifiche

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 28/9/2009 il Listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

“Abaxbank Equity Protection Certificate sull’azione Mediobanca quotato su SeDeX”: rettifica per aumento gratuito del capitale sociale da parte di Mediobanca.

In relazione all’aumento gratuito del capitale sociale di Mediobanca da realizzarsi mediante l’assegnazione, a beneficio di ciascun azionista, di una nuova azione ordinaria Mediobanca ogni venti azioni e di un warrant per ogni azione, così come descritto nell’Avviso di Borsa Italiana n. 14765 del 23 settembre 2009, il presente comunicato descrive la modalità di rettifica del seguente Equity Protection Certificate, emesso da Abaxbank S.p.A. in base alla Nota Informativa “Abaxbank Equity Protection Certificates su Azioni e Indici Azionari” (la “Nota Informativa”) e quotato sul mercato SeDeX (il “Certificate”):

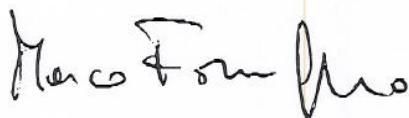
Codice ISIN	Azione sottostante	Livello di Protezione	Multiplo	Fattore di Partecipazione	Data Scadenza
IT0004151269	Mediobanca	Euro 17,28	1	85%	15 dicembre 2010

L’articolo 6 del Regolamento allegato alla Nota Informativa prevede che gli Equity Protection Certificates siano rettificati allorché l’Azione sottostante sia oggetto di un Evento Rilevante (ivi inclusa un’operazione di aumento gratuito del capitale). Nel caso di specie, considerato l’articolo 6, comma 4, lettera (i) del Regolamento allegato alla Nota Informativa e considerate le modalità di rettifica dei contratti di opzione negoziati sul mercato IDEM, come disposte dall’avviso di Borsa Italiana n. 14765 del 23 settembre 2009, l’intervento di rettifica viene effettuato moltiplicando il Livello di Protezione e dividendo il Multiplo per il coefficiente K, così determinato da Borsa Italiana alla chiusura delle negoziazioni del 25 settembre 2009, $K=0,933788$.

Le caratteristiche del Certificate, a seguito della rettifica, saranno così modificate:

Codice ISIN	Azione sottostante	Nuovo Livello di Protezione	Nuovo Multiplo	Fattore di Partecipazione
IT0004151269	Mediobanca	Euro 16,1358	1,0709	85%

La data di efficacia della rettifica sarà il 28 settembre 2009.



“Abaxbank Autocallable Twin Win Certificates sull’azione Mediobanca – 2007/2012” quotato su SeDeX: rettifica per aumento gratuito del capitale sociale da parte di Mediobanca.

In relazione all’aumento gratuito del capitale sociale di Mediobanca da realizzarsi mediante l’assegnazione, a beneficio di ciascun azionista, di una nuova azione ordinaria Mediobanca ogni venti azioni e di un warrant per ogni azione, così come descritto nell’Avviso di Borsa Italiana n. 14765 del 23 settembre 2009, il presente comunicato descrive la modalità di rettifica del seguente Autocallable Twin Win Certificate, emesso da Abaxbank S.p.A. in base alla Nota Informativa “Abaxbank Autocallable Twin Win Certificates su Azioni e Indici Azionari” (la “Nota Informativa”) e quotato sul mercato SeDeX (il “Certificate”):

Codice ISIN	Azione sottostante	Valore di Autocallability	Data Scadenza
IT0004176696	Mediobanca	Euro 17,533	13 febbraio 2012

L’articolo 6 del Regolamento allegato alla Nota Informativa prevede che gli Autocallable Twin Win Certificates siano rettificati allorché l’Azione sottostante sia oggetto di un Evento Rilevante (ivi inclusa un’operazione di aumento gratuito del capitale). Nel caso di specie, considerato l’articolo 6, comma 4, lettera (i) del Regolamento allegato alla Nota Informativa e considerate le modalità di rettifica dei contratti di opzione negoziati sul mercato IDEM, come disposte dall’avviso di Borsa Italiana n. 14765 del 23 settembre 2009, l’intervento di rettifica viene effettuato moltiplicando il Valore di Autocallability per il coefficiente K, così determinato da Borsa Italiana alla chiusura delle negoziazioni del 25 settembre 2009, $K=0,933788$.

Le caratteristiche del Certificate, a seguito della rettifica, saranno così modificate:

Codice ISIN	Nuovo Valore di Autocallability
IT0004176696	Euro 16,3721

La data di efficacia della rettifica sarà il 28 settembre 2009.

Si precisa infine che non si procede alla rettifica del Livello della Barriera poiché, come comunicato in data 9 giugno 2008, in tale data si è verificato l’Evento Barriera.

