

**AVVISO n.10364**

**19 Giugno 2009**

**SeDeX – LEV.  
CERTIFICATES**

Mittente del comunicato : ABN AMRO BANK  
Societa' oggetto : ABN AMRO BANK  
dell'Avviso  
Oggetto : Certificate – Rettifiche

***Testo del comunicato***

Si veda allegato.

***Disposizioni della Borsa***

Dal giorno 22/6/2009 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

Londra, 19 giugno 2009

**OGGETTO: ABN AMRO BANK N.V. Certificates su azione UBI.  
 Rettifiche a seguito dell'offerta in opzione di obbligazioni convertibili agli azionisti.**

Premesso

- che ABN AMRO BANK N.V. ha emesso e quotato sul SeDeX i seguenti Certificates ("Certificates") con l'azione ordinaria UBI Banca ("UBI") ISIN IT0003487029 quale sottostante, nell'ambito del proprio *Base Prospectus relating to Certificates* approvato dall'Autorità olandese e riconosciuto in Italia;

<b>Tipo di certificate</b>	<b>ISIN</b>
Mini Long	NL0009052984
Mini Long	NL0009055680
Mini Short	NL0009008689

- che UBI ha annunciato l'offerta in opzione ai propri azionisti di obbligazioni convertibili in azioni ordinarie del prestito "UBI 2009/2013 convertibile con facoltà di rimborso in azioni" emesse da UBI Banca (cfr. Avvisi di Borsa Italiana n. 10275 del 18 giugno 2009 e n. 10347 del 19 giugno 2009).

Visti

- i rispettivi Regolamenti dei Certificates, in forza dei quali, al verificarsi di un evento come l'assegnazione di diritti d'opzione ai portatori del sottostante dei Certificates, ABN AMRO Bank N.V. può effettuare correzioni ad uno o più parametri dei Certificates, in modo tale che il valore economico dei medesimi rimanga sostanzialmente equivalente a quello che i medesimi avevano prima del verificarsi di quell'evento;
- il fattore di aggiustamento adottati dal mercato IDEM, le cui modalità di calcolo sono indicate nell'Avviso di Borsa n. 10277 del 18 giugno 2009;

la scrivente ABN AMRO BANK N.V., comunica che, con decorrenza 22 giugno 2009, utilizzando – coerentemente al criterio di rettifica adottato dal mercato IDEM - il fattore di aggiustamento 0,988949 (come pubblicato alla chiusura delle negoziazioni in data odierna, cfr. Avviso di Borsa Italiana n. 10356), rettificcherà alcuni parametri dei Certificates come descritto nella sottostante Tabella A.

**ABN AMRO BANK N.V. Certificates su azione UBI – (caratteristiche a partire dal, e incluso il, 22 giugno 2009)**

**TABELLA A**

Tipo di certificate	ISIN	Titolo Sottostante	Current Strike Level	Livello Stop Loss	Parità
Mini Long	NL0009052984	UBI	3,59	3,85	0,101693
Mini Long	NL0009055680	UBI	7,52	8,05	0,101693
Mini Short	NL0009008689	UBI	12,56	11,67	0,101693

Per un raffronto, si precisa che i parametri dei suddetti Certificates, sono attualmente quelli indicati nella sottostante Tabella B.

**ABN AMRO BANK N.V. Certificates su azione UBI - (caratteristiche fino al, e incluso il, 19 giugno 2009)**

**TABELLA B**

Tipo di certificate	ISIN	Titolo Sottostante	Current Strike Level	Livello Stop Loss	Parità
Mini Long	NL0009052984	UBI	3,63	3,89	0,100569
Mini Long	NL0009055680	UBI	7,60	8,13	0,100569
Mini Short	NL0009008689	UBI	12,70	11,81	0,100569

Con riferimento ai Mini Long, quanto ai nuovi valori del Current Strike Level da applicare con decorrenza 22.6.2009 ed indicati nella Tabella A sopra, si precisa per chiarezza che detti valori sono ricalcolati sulla base della seguente formula:

- (i) Current Strike Level comunicato per la data 19 giugno 2009 (i.e., i valori del Current Strike Level indicati nella Tabella B sopra);
- (ii) più il Costo della Provvista per i giorni di calendario intercorrenti tra il 19.6.2009 e il 22.6.2009. Il Costo della Provvista comprende due fattori: il tasso Libor overnight e lo Spread. Il tasso Libor overnight è ridotto dello Spread in caso di Mini Futures Short ed è aumentato dello Spread in caso di Mini Futures Long. Il Costo della Provvista è poi diviso per 360 giorni;
- (iii) moltiplicato il fattore di aggiustamento sopra indicato.

Al riguardo, si noti che il tasso Libor overnight è pari a 0,7875 %, lo Spread è pari a 2,5%, i giorni intercorsi tra il 19.6.2009 e il 22.6.2009 sono 3 ed il fattore di aggiustamento è pari a 0,988949.

In fede

ABN AMRO Bank N.V.