

AVVISO n.5935	05 Aprile 2007	SeDeX – PLAIN VANILLA
----------------------	-----------------------	----------------------------------

Mittente del comunicato : BANCA IMI
Societa' oggetto : BANCA IMI
dell'Avviso
Oggetto : Securitised Derivatives – Comunicato Stampa

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Pr.n. FM/SM/061143/07

Milano, 5 aprile 2007

Oggetto: Covered Warrant Banca IMI S.p.A. su S&P/MIB, scadenza 20 aprile 2007, emessi a valere sulla Nota Informativa – Programma “Covered Warrant Banca IMI S.p.A. su Indici Azionari”.

Si fa riferimento ai covered warrant in oggetto, riportati nella tabella sottostante, ammessi alla quotazione ufficiale di borsa in data 29 novembre 2006 con provvedimento n. 4991 ed entrati in negoziazione sul Sedex – Segmento Covered Warrant Plain Vanilla” il 7 dicembre 2006,

Serie	Codice ISIN	Indice Sottostante	Tipo	Strike	Scadenza
1	IT0004150030	S&P/MIB	Put	38000	20/04/2007
2	IT0004150048	S&P/MIB	Call	39000	20/04/2007
3	IT0004150055	S&P/MIB	Put	39000	20/04/2007
4	IT0004150063	S&P/MIB	Call	40000	20/04/2007
5	IT0004150071	S&P/MIB	Put	40000	20/04/2007
6	IT0004150089	S&P/MIB	Call	41000	20/04/2007
7	IT0004150097	S&P/MIB	Put	41000	20/04/2007
8	IT0004150105	S&P/MIB	Call	42000	20/04/2007
9	IT0004149818	S&P/MIB	Call	43000	20/04/2007
10	IT0004149826	S&P/MIB	Call	44000	20/04/2007

Al riguardo si comunica, ai sensi dell'art. 12 del Regolamento dei “Covered Warrant Banca IMI S.p.A. su Indici Azionari” che, non essendo prevista la scadenza di alcun contratto future relativo all'indice S&P/MIB nel mese di aprile 2007 (mese di scadenza dei Covered Warrant in oggetto), s'intende, per finalità di eliminazione di ogni ambiguità od imprecisione, integrare la definizione di Prezzo di Riferimento Finale relativa a tali Covered Warrant di cui all'art. 2 lett. (ggg) del Regolamento nel senso di prevedere a chiarimento che il Prezzo di Riferimento, ove non sia disponibile il livello di liquidazione del contratto future sull'indice S&P/MIB con scadenza in pari data quotato sul mercato regolamentato dei derivati IDEM, coincide con il livello di apertura dell'indice S&P/MIB alla Data di Scadenza.

Si significa che la suindicata modifica è a correzione di una mera imprecisione ed ambiguità e non pregiudica i diritti e gli interessi dei Portatori dei Covered Warrant in oggetto, attesa la coincidenza fra il livello di liquidazione del contratto future sull'indice S&P/MIB quotato sul mercato regolamentato dei derivati IDEM ed il livello di apertura dell'indice S&P/MIB.



Banca IMI SpA

