

AVVISO n.8746	15 Maggio 2009	SeDeX – PLAIN VANILLA
----------------------	-----------------------	----------------------------------

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

Testo del comunicato

Si veda avviso n. 8280 del 13/5/2009.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 18/5/2009 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

Milano, 15 maggio 2009

**Oggetto: Covered Warrant Banca IMI S.p.A. su azioni ordinarie UNICREDIT:
rettifica a seguito di distribuzione dividendo straordinario.**

La presente per comunicare, ai sensi dell'art. 2.2.24, comma 1, lettera (e), del Regolamento dei Mercati Organizzati e Gestiti dalla Borsa Italiana S.p.A., le modalità di rettifica dei Covered Warrant sull'azione Unicredit emessi da Banca IMI S.p.A. (l'"**Emittente**") e che, alla data odierna, sono in quotazione presso il Mercato Telematico dei Securitised Derivatives.

In particolare, considerato che:

- sull'azione UNICREDIT (Isin IT0000064854) verrà corrisposto un dividendo pari a 29 nuove azioni ordinarie ogni 159 azioni ordinarie possedute (come da Avviso di Borsa n.7365 del 30 aprile 2009), con quotazione ex dividendo fissata per il 18 maggio 2009.
- L' Avviso di Borsa n. 7396 del 30 aprile 2009 illustra le modalità di rettifica per le serie di contratti di opzione sull'azione Unicredit.
- Ai sensi dei Regolamenti contenuti nelle Note Informativo-Programma, a seguito del verificarsi degli Eventi relativi all'azione sottostante indicati nei medesimi Regolamenti, e laddove sull'azione sottostante siano negoziati, sul Mercato

Derivato di Riferimento, contratti di opzione, i Covered Warrant vengono rettificati con la medesima metodologia utilizzata dall'Idem, ossia moltiplicando lo Strike Price e dividendo il Multiplo per il coefficiente k (pari a 0.887308) di rettifica come determinato da Borsa Italiana S.p.A. alla chiusura delle Negoziazioni del 15 maggio 2009.

L'Emittente procede alla rettifica dei Covered Warrant.

La rettifica sarà efficace a partire da lunedì 18 maggio 2009.

Nel prospetto che segue sono riportati i termini della rettifica:

CODICE ISIN WARRANT	AZIONE SOTTOSTANTE	DATA DI SCADENZA	STRIKE PRICE (PRECEDENTE)	STRIKE PRICE (RETTIFICATO)	MULTIPLIO (PRECEDENTE)	MULTIPLIO (RETTIFICATO)
IT0004435456	Unicredit	01/06/09	2.40	2.1295	0.1	0.112700
IT0004462070	Unicredit	01/06/09	1.50	1.3309	0.1	0.112700
IT0004462088	Unicredit	01/06/09	1.80	1.5971	0.1	0.112700
IT0004462096	Unicredit	07/09/09	1.60	1.4196	0.1	0.112700
IT0004462104	Unicredit	07/09/09	2.00	1.7746	0.1	0.112700

Banca IMI S.p.A.