

**AVVISO n.10749**

**17 Giugno 2011**

**SeDeX – PLAIN  
VANILLA**

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

***Testo del comunicato***

Si veda allegato.

***Disposizioni della Borsa***

Dal giorno 20/6/2011 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

Spettabile  
**BORSA ITALIANA S.p.A**  
Piazza degli Affari, 6  
20123 Milano

Milano, 17 giugno 2011

Oggetto: **Covered Warrant Banca IMI su Azioni Italiane – Rettifica Strike e Multipli a seguito di aumento a pagamento del capitale sociale di Banca Monte dei Paschi di Siena (cod. ISIN IT0001334587).**

A seguito dell'operazione di aumento a pagamento del capitale sociale - come da Avviso di Borsa Italiana n° 10714 del 17 Giugno 2011 - agli aventi diritto di Monte dei Paschi di Siena (codice ISIN IT0001334587), verranno assegnate azioni ordinarie nel rapporto di n° 18 nuove azioni ordinarie ogni n° 25 azioni ordinarie possedute.

Banca IMI S.p.A., ai sensi del Regolamento contenuto nella Nota Informativa-Programma, a seguito del verificarsi degli Eventi relativi all'azione sottostante indicati nel medesimo Regolamento, procede alla rettifica dei Covered Warrant applicando i criteri del Mercato degli Strumenti Derivati (IDEM), come da Avviso n° 10666 del 16 Giugno 2011, utilizzando il fattore di rettifica "K" pari a 0,845018 come determinato dal mercato IDEM al termine delle contrattazioni in data odierna.

In particolare il Multiplo viene rettificato dividendo il precedente valore per il coefficiente di rettifica "K", mentre lo Strike Price viene rettificato moltiplicando il precedente valore per il coefficiente di rettifica "K".

Banca IMI S.p.A. rettifica gli Strike e i Multipli dei Covered Warrant in oggetto come segue:

ISIN	SOTTOSTANTE	TIPO	CATEGORIA	SCADENZA	Vecchio Strike	Nuovo Strike	Vecchio Multiplo	Nuovo Multiplo
IT0004697386	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/09/2011	1,1	0,9295	0,1	0,118340
IT0004697394	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/09/2011	1,2	1,0140	0,1	0,118340
IT0004697402	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/09/2011	1,3	1,0985	0,1	0,118340
IT0004724784	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/12/2011	1	0,8450	0,1	0,118340
IT0004724792	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/12/2011	1,1	0,9295	0,1	0,118340
IT0004724800	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/12/2011	1,2	1,0140	0,1	0,118340
IT0004724818	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/03/2012	1	0,8450	0,1	0,118340
IT0004724826	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/03/2012	1,1	0,9295	0,1	0,118340
IT0004724834	Banca Monte Paschi	Call	Covered Warrant	05/03/2012	1,2	1,0140	0,1	0,118340

La rettifica avrà effetto a partire da lunedì 20 giugno 2011.

Distinti saluti  
**BANCA IMI S.p.A.**