

AVVISO n.10747

17 Giugno 2011

**SeDeX – PLAIN
VANILLA**

Mittente del comunicato : UNICREDIT
Societa' oggetto dell'Avviso : UNICREDIT
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.

Spett.le
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza degli Affari, 6
MILANO

Milano, 17.06.2011

Oggetto: avviso di rettifica di covered warrant legati alle azioni BANCA MONTE PASCHI SIENA (IT0001334587) emessi da UniCredit in seguito all'aumento a pagamento del capitale sociale di BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA attuato mediante offerta in opzione agli azionisti ordinari di nuove azioni ordinarie

A seguito dell'aumento a pagamento del capitale sociale di BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA attuato mediante offerta in opzione agli aventi diritto, titolari di qualsivoglia categoria di azioni in circolazione, di 18 azioni ordinarie di nuova emissione per ogni 25 azioni possedute (si veda Avviso di Borsa numero 10714 del 17 Giugno 2011), UniCredit in qualità di emittente dei covered warrant, sulla base di quanto previsto dal regolamento degli stessi, intende rettificare, in conformità alle modalità di rettifica previste dal mercato IDEM (Avviso numero 10666 del 16 Giugno 2011), i covered warrant emessi da UniCredit sulle azioni BANCA MONTE PASCHI SIENA al fine di mantenere invariata la posizione finanziaria dei portatori di tali titoli.

Pertanto a partire dal 20.06.2011 gli strike dei covered warrant di UniCredit su BANCA MONTE PASCHI SIENA saranno rettificati moltiplicando i valori correnti per il coefficiente di rettifica K, come determinato dal mercato IDEM alla chiusura delle negoziazioni del 17 Giugno 2011, mentre il multiplo di tutti gli strumenti sarà diviso per il coefficiente di rettifica K, con K pari a:

Coefficiente di rettifica $K = 0,845018$

Nella tabella 1 sono riportate le specifiche dei covered warrant aggiornati a seguito della rettifica; gli effetti della rettifica saranno efficaci a partire dal 20.06.2011.

UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
20121 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.it

UniCredit S.p.A. - Sede Sociale: ROMA Via A. Specchi, 16- Direzione Generale: MILANO Piazza Cordusio, iscrizione al Registro delle Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA n° 00348170101, iscritta all'Albo delle Banche e capogruppo del Gruppo Bancario UniCredit, Albo dei Gruppi Bancari: cod.3135.1 - Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei Depositi - capitale sociale €9.649.245.346,50, interamente versato.

Tabella 1 - covered warrant di UniCredit

ISIN	Sottostante	ISIN sottostante	Tipo	Scadenza	Strike	Nuovo Strike	Multi plo	Nuovo Multiplo
IT0004685175	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/09/2011	0.95	0.8028	0.1	0.1183
IT0004685183	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/09/2011	1.05	0.8873	0.1	0.1183
IT0004685191	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/09/2011	1.15	0.9718	0.1	0.1183
IT0004685209	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Put	02/09/2011	0.95	0.8028	0.1	0.1183
IT0004685217	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Put	02/09/2011	0.85	0.7183	0.1	0.1183
IT0004704919	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/09/2011	0.85	0.7183	0.1	0.1183
IT0004731672	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Put	02/09/2011	0.75	0.6338	0.1	0.1183
IT0004731680	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/12/2011	0.8	0.6760	0.1	0.1183
IT0004731698	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/12/2011	0.9	0.7605	0.1	0.1183
IT0004731706	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/12/2011	1	0.8450	0.1	0.1183
IT0004731714	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Call	02/12/2011	1.1	0.9295	0.1	0.1183
IT0004731722	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Put	02/12/2011	0.9	0.7605	0.1	0.1183
IT0004731730	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Put	02/12/2011	0.8	0.6760	0.1	0.1183
IT0004731748	BANCA MONTE PASCHI SIENA	IT0001334587	Put	02/12/2011	0.7	0.5915	0.1	0.1183

Distinti saluti,

UniCredit S.p.A.

UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
20121 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.it

UniCredit S.p.A. - Sede Sociale: ROMA Via A. Specchi, 16- Direzione Generale: MILANO Piazza Cordusio, iscrizione al Registro delle Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA n° 00348170101, iscritta all'Albo delle Banche e capogruppo del Gruppo Bancario UniCredit, Albo dei Gruppi Bancari: cod.3135.1 - Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei Depositi - capitale sociale €9.649.245.346,50, interamente versato.