



AVVISO n.10642	06 Giugno 2014	SeDeX - INV. CERTIFICATES
---------------------------	----------------	------------------------------

Mittente del comunicato : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE

Societa' oggetto : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
dell'Avviso

Oggetto : Certificates - Rettifiche

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 9/6/2014 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.



BNP PARIBAS

Milano, 06/06/2014

**OGGETTO: RETTIFICA DI INVESTMENT CERTIFICATE EMESSI DA BNP PARIBAS
ARBITRAGE ISSUANCE B.V. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA**

- **Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:** Operazione di aumento del capitale sociale da parte di Monte dei Paschi di Siena (codice Isin: IT0004984842), mediante offerta in opzione di diritti di sottoscrizione di n° 214 nuove azioni ogni n° 5 azioni possedute, ad un prezzo di sottoscrizione di 1.00 euro per azione (si veda l'avviso 10501 del 05 Giugno 2014).
- **Data di efficacia** 09/06/2014
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** IT0004984842
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Rettifica:**

La società BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. in qualità di emittente di Investment Certificate, sulla base di quanto descritto all'interno del Regolamento dei Covered Warrant e degli Investment Certificate, nel tempo modificato e aggiornato, intende rettificare gli Investment Certificate su azioni Monte dei Paschi di Siena, quotati sul mercato SeDeX di Borsa Italiana S.P.A., in conformità alle modalità di rettifica adottate dal mercato IDEM (si veda l'avviso 10607 del 6 Giugno 2014) attraverso una modifica dei valori di riferimento del Certificate in base al coefficiente di rettifica **K**, secondo quanto riportato in Tabella 1 (in allegato).

Viene calcolato un coefficiente di rettifica **K** calcolato al termine delle negoziazioni della giornata del 6 Giugno 2014, ottenuto con la seguente formula :

$$K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}} = 0.062489$$

- P_{ex} = prezzo "ex diritto"
- P_{cum} = prezzo "cum diritto"

ALLEGATI

Tabella 1: Rettifica Investment Certificate con sottostante Monte dei Paschi di Siena

<i>ISIN</i>	<i>Tipologia di prodotto</i>	<i>Sottostante</i>	<i>Strike price Ante rettifica</i>	<i>Strike price Post rettifica</i>	<i>Knock-out Level Ante rettifica</i>	<i>Knock-out Level Post rettifica</i>	<i>Cap Level Ante rettifica</i>	<i>Cap Level Post rettifica</i>	<i>Scadenza</i>
NL0010397568	Bonus Cap	Monte dei Paschi di Siena	21.19	1.3241	12.71	0.7942	24.58	1.5360	20/06/2014
NL0010398855	Bonus Cap	Monte dei Paschi di Siena	20.74	1.2960	14.52	0.9073	24.27	1.5166	19/09/2014

<i>ISIN</i>	<i>Tipologia di prodotto</i>	<i>Sottostante</i>	<i>Strike price Ante rettifica</i>	<i>Strike price Post rettifica</i>	<i>Knock-out Level Ante rettifica</i>	<i>Knock-out Level Post rettifica</i>	<i>Scadenza</i>
NL0010398053	Fixed Premium Athena	Monte dei Paschi di Siena	21.00	1.3123	12.60	0.7874	17/07/2015

- DATA DI EFFICACIA DELLA RETTIFICA 09/06/2014