

AVVISO n.8754	15 Maggio 2009	SeDeX – PLAIN VANILLA
----------------------	-----------------------	----------------------------------

Mittente del comunicato : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
Societa' oggetto : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
dell'Avviso
Oggetto : Securitised Derivatives – Rettifica Strike e
Parità

Testo del comunicato

Si veda l'avviso n. 8276 del 13/5/2009.

Disposizioni della Borsa

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



Milano 15/05/2009

Oggetto: Modalità di Rettifica dei Covered Warrant su Mediaset emessi da BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.

Testo :

In relazione all'operazione di pagamento di dividendo pari a 0,38 Euro (cfr. Avviso di Borsa Italiana n. 6644 del 23 aprile 2009), di cui una quota pari a 0,0611 Euro per azione da considerarsi straordinario, ai portatori di azioni Mediaset (ISIN: IT0001063210), la società BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. in qualità di emittente di Covered Warrants, sulla base di quanto descritto all'interno del Regolamento dei Covered Warrants, come nel tempo modificato e aggiornato, intende rettificare tutti i Covered Warrant su azioni Mediaset quotati presso Borsa Italiana S.P.A., in conformità con quanto previsto dalla Borsa Italiana per il mercato IDEM nell'avviso n°7392 del 30 Aprile 2009.

La rettifica avverrà seguendo la metodologia di seguito specificata:

Viene calcolato un coefficiente di rettifica **K** pari a **0,985692**, ottenuto con la seguente formula :

$$K = \frac{(P_{uff} - \text{quota del dividendo ordinario}) - \text{quota del dividendo straordinario}}{P_{uff} - \text{quota del dividendo ordinario}}$$

- P_{uff} = prezzo ufficiale *cum diritto*
- quota del dividendo ordinario = 0,3189 Euro
- quota del dividendo straordinario = 0,0611 Euro

La rettifica avverrà moltiplicando lo strike per il coefficiente **K** e dividendo il multiplo per **K**.

Codice ISIN	DESCRIZIONE	STRIKE PRECEDENTE	ISIN SOTTOSTANTE	STRIKE NUOVO	MULTIPLIO PRECEDENTE	MULTIPLIO NUOVO	SCADENZA
NL0006298325	Covered Warrant su Mediaset CALL	5	IT0001063210	4,9285	0,1	0,101452	01/06/2009
NL0006298333	Covered Warrant su Mediaset CALL	6,5	IT0001063210	6,4070	0,1	0,101452	01/06/2009
NL0009083195	Covered Warrant su Mediaset CALL	4	IT0001063210	3,9428	0,1	0,101452	01/06/2009
NL0009083203	Covered Warrant su Mediaset CALL	4,5	IT0001063210	4,4356	0,1	0,101452	01/09/2009
NL0009083211	Covered Warrant su Mediaset CALL	5	IT0001063210	4,9285	0,1	0,101452	01/09/2009

Le rettifiche avranno efficacia a far data dal 18 Maggio 2009.