

AVVISO n.2662	26 Febbraio 2010	SeDeX
----------------------	-------------------------	--------------

Mittente del comunicato : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
Societa' oggetto : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
dell'Avviso
Oggetto : Rettifica Banco Popolare

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 1/3/2010 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.



BNP PARIBAS

Milano 26/02/2010

Oggetto: Modalità di Rettifica di Covered Warrants e Investment Certificates su Banco Popolare emessi da BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.

Testo :

In relazione all'offerta in opzione agli azionisti di obbligazioni convertibili del prestito "Banco Popolare 2010/2014 4,75% convertibile con facoltà di rimborso in azioni" emesse da Banco Popolare (Codice Isin IT0004231566), si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 2646 del 26 febbraio 2010, la società BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. in qualità di emittente di Covered Warrants e Investment Certificates, sulla base di quanto descritto all'interno del Regolamento dei Coverei Warrants e Investment Certificates, come nel tempo modificato e aggiornato, intende rettificare tutti i gli Investment Certificates e Covered Warrants su azioni Banco Popolare quotati presso Borsa Italiana S.P.A., in conformità con quanto previsto dalla Borsa Italiana per il mercato IDEM nell'avviso n. 2482 del 24 febbraio 2010.

Come da comunicato del mercato Idem dopo la chiusura delle negoziazioni in data odierna, il **k** è pari a **0,963548**.

Per i Bonus Cap su Banco Popolare la rettifica avverrà moltiplicando il Valore Iniziale dell'azione ($Share_{initial}$), la Barriera e il Livello Cap per il coefficiente **K**.

Codice ISIN	DESCRIZIONE	ShareInitial PRECEDE NTE	ShareInitial NUOVO	BARRIERA PRECEDE NTE	BARRIERA NUOVA	LIVELLO CAP PRECEDENTE	LIVELLO CAP NUOVO	SCADENZA
NL0009098904	Bonus Cap su Banco Popolare	5,825	5,6127	3,79	3,6518	8,16	7,8626	02/11/2011
NL0009098961	Bonus Cap su Banco Popolare	5,825	5,6127	3,96	3,8157	6,06	5,8391	04/05/2010

Per quanto riguarda i Covered Warrant su Banco Popolare la rettifica avverrà moltiplicando lo strike per il coefficiente **K** e dividendo il multiplo per **K**.

Codice ISIN	DESCRIZIONE	STRIKE PRECEDENTE	STRIKE NUOVO	MULTIPLIO PRECEDENTE	MULTIPLIO NUOVO	SCADENZA
NL0009099092	Covered Warrant su Banco Popolare CALL	9	8,6719	0,1	0,103783	19/03/2010
NL0009099100	Covered Warrant su Banco Popolare CALL	11	10,5990	0,1	0,103783	18/06/2010
NL0009328244	Covered Warrant su Banco Popolare CALL	6	5,7813	0,1	0,103783	19/03/2010
NL0009328251	Covered Warrant su Banco Popolare CALL	7	6,7448	0,1	0,103783	18/06/2010
NL0009328269	Covered Warrant su Banco Popolare CALL	8	7,7084	0,1	0,103783	17/09/2010

Le rettifiche avranno efficacia a far data dal 01 marzo 2010.