

AVVISO n.18128

28 Ottobre 2011

**SeDeX – PLAIN
VANILLA**

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

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 31/10/2011 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

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

Milano, 28 ottobre 2011

Oggetto: **Covered Warrant Banca IMI su Azioni Italiane – Rettifica Strike e Multipli a seguito di aumento a pagamento del capitale sociale di BANCA POPOLARE DI MILANO S.c.a.r.l. (codice ISIN IT0000064482).**

A seguito dell'operazione di aumento a pagamento del capitale sociale – come da Avviso di Borsa Italiana n° 18103 del 28 ottobre 2011 – agli azionisti di Banca Popolare di Milano e ai portatori delle obbligazioni del prestito denominato “Convertendo BPM 2009/2013 6,75%” (le “Obbligazioni”), in data 31 ottobre 2011, verranno offerti in opzione azioni ordinarie Banca Popolare di Milano (codice ISIN IT0000064482) in ragione di n. 138 nuove azioni ordinarie ogni n. 25 azioni ordinarie possedute e n. 92 nuove azioni ordinarie ogni n. 1 Obbligazione posseduta, al prezzo di sottoscrizione di Euro 0,30 per azione.

Banca IMI S.p.A., ai sensi del Regolamento contenuto nella Nota Informativa-Programma, a seguito del verificarsi dell'Evento Rilevante relativo all'azione sottostante indicato nel medesimo Regolamento, procede alla rettifica dei Covered Warrant applicando i criteri del Mercato degli Strumenti Derivati (IDEM), come da Avviso n° 17989 del 27 ottobre 2011, utilizzando il fattore di rettifica “K” pari a 0.324099, come determinato dal mercato IDEM alla chiusura delle negoziazioni del 28 ottobre 2011.

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
IT0004724453	Banca Pop. Milano	Call	Covered Warrant	05/12/2011	2.40	0.7778	0.1	0.308547
IT0004724461	Banca Pop. Milano	Call	Covered Warrant	05/12/2011	2.60	0.8426	0.1	0.308547
IT0004724479	Banca Pop. Milano	Call	Covered Warrant	05/12/2011	2.80	0.9074	0.1	0.308547
IT0004724487	Banca Pop. Milano	Call	Covered Warrant	05/03/2012	2.50	0.8102	0.1	0.308547
IT0004724495	Banca Pop. Milano	Call	Covered Warrant	05/03/2012	3.00	0.9722	0.1	0.308547

La rettifica avrà effetto a partire da lunedì 31 ottobre 2011.

Distinti saluti

BANCA IMI S.p.A.