

AVVISO n.2664	26 Febbraio 2010	SeDeX – PLAIN VANILLA
----------------------	-------------------------	----------------------------------

Mittente del comunicato : BANCA IMI
Societa' oggetto dell'Avviso : BANCA IMI
Oggetto : Corporate Action Banco Popolare

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

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

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

Milano, 26 febbraio 2010

Oggetto: **Covered Warrant Banca IMI su Azioni Italiane – Rettifica Strike e Multipli a seguito di offerta in opzione di obbligazioni convertibili del prestito “Banco Popolare 2010/2014 (4,75%) convertibile con facoltà di rimborso in azioni”.**

A seguito dell'operazione di offerta in opzione di obbligazioni convertibili del prestito “Banco Popolare 2010/2014 (4,75%) convertibile con facoltà di rimborso in azioni” ordinarie Banco Popolare (codice ISIN IT0004231566), come da Avviso di Borsa Italiana n.2475 del 24 febbraio 2010:

Banca IMI S.p.A., ai sensi del Regolamento contenuto nella Nota Informativa-Programma, a seguito del verificarsi degli Eventi relativi all'azione sottostante indicati nel medesimo Regolamento, procede alla rettifica dei Covered Warrant applicando i criteri del Mercato degli Strumenti Derivati (IDEM), come da Avviso n. 2482 del 24 febbraio 2010, utilizzando il fattore di rettifica “K” pari a 0,963548 come determinato da Borsa Italiana S.p.A. alla chiusura delle negoziazioni del 26 febbraio 2010.

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
IT0004562705	Banco Popolare	Call	Covered Warrant	07/06/2010	6,00	5,7812	0,1000	0,103783
IT0004562713	Banco Popolare	Call	Covered Warrant	07/06/2010	6,50	6,2630	0,1000	0,103783

La rettifica avrà effetto a partire da lunedì 1 marzo 2010.

Distinti saluti
BANCA IMI S.p.A.