

AVVISO n.268	06 Gennaio 2012	SeDeX – PLAIN VANILLA
---------------------	------------------------	----------------------------------

Mittente del comunicato : BANCA IMI
Societa' oggetto dell'Avviso : BANCA IMI
Oggetto : Covered warrant – rettifica strike price e parità

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 9/1/2012 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza

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

Milano, 6 gennaio 2012

Oggetto: Covered Warrant Banca IMI su Azioni Italiane – Rettifica Strike e Multipli a seguito di aumento a pagamento del capitale sociale di Unicredit S.p.A. (codice ISIN IT0004781412).

A seguito dell'operazione di aumento a pagamento del capitale sociale – come da Avviso di Borsa Italiana n° 176 del 4 gennaio 2012 – agli azionisti di Unicredit S.p.A., in data 9 gennaio 2012, verranno offerti in opzione azioni ordinarie Unicredit S.p.A. (codice ISIN IT0004781412) in ragione di n. 2 nuove azioni ordinarie ogni n. 1 azione ordinaria e/o di risparmio posseduta, al prezzo di sottoscrizione di Euro 1,943 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° 185 del 4 gennaio 2012, utilizzando il fattore di rettifica "K" pari a 0,658631, come determinato dal mercato IDEM alla chiusura delle negoziazioni del 6 gennaio 2012.

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
IT0004724990	Unicredit	Call	Covered Warrant	05/03/2012	18.0000	11.8553	0.010000	0.015183
IT0004725005	Unicredit	Call	Covered Warrant	05/03/2012	20.0000	13.1726	0.010000	0.015183
IT0004725013	Unicredit	Call	Covered Warrant	05/03/2012	22.0000	14.4898	0.010000	0.015183

La rettifica avrà effetto a partire da lunedì 9 gennaio 2012.

Distinti saluti

BANCA IMI S.p.A.

