

AVVISO n.10362

19 Giugno 2009

**SeDeX – INV.
CERTIFICATES**

Mittente del comunicato : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
Societa' oggetto : BNP PARIBAS ARBITRAGE ISSUANCE
dell'Avviso
Oggetto : Certificates – Rettifiche

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 22/06/2009 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.



BNP PARIBAS

Milano 19/06/2009

Oggetto: Modalità di Rettifica degli Investment Certificates su UBI Banca emessi da BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.

Testo :

In relazione all'offerta in opzione agli azionisti di obbligazioni convertibili in azioni ordinarie del prestito "UBI 2009/2013 convertibile con facoltà di rimborso in azioni" emesse da UBI BANCA (Codice Isin IT0003487029), si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 10347 del 19 giugno 2009, la società BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. in qualità di emittente di Investment Certificates, sulla base di quanto descritto all'interno del Regolamento degli Investment Certificates, come nel tempo modificato e aggiornato, intende rettificare tutti i gli Investment Certificates su azioni UBI Banca quotati presso Borsa Italiana S.P.A., in conformità con quanto previsto dalla Borsa Italiana per il mercato IDEM nell'avviso n°10277 del 18 giugno 2009.

L'intervento di rettifica avviene mediante l'applicazione del coefficiente **K**, pari a **0,988949**, (si veda Avviso dell'Idem n. 10356 del 19 giugno 2009) calcolato secondo la seguente formula riportata e arrotondato alla sesta cifra decimale:

$$\mathbf{K} = \frac{P_{ex}}{P_{cum}}$$

- P_{ex} = prezzo "ex diritto"
- P_{cum} = prezzo "cum diritto"

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

La tabella seguente riporta la metodologia di calcolo per i Bonus Cap su UBI Banca:

Codice ISIN	DESCRIZIONE	Share_{Initial} PRECEDENTE	Share_{Initial} NUOVO	BARRIERA PRECEDENTE	BARRIERA NUOVA	LIVELLO BONUS = LIVELLO CAP PRECEDENTE	LIVELLO BONUS = LIVELLO CAP NUOVO	SCADENZA
NL0006295511	Bonus Cap su UBI Banca	14,7660	14,6028	Not Applicable*	Not Applicable*	19,1958	18,9837	24/06/2011
NL0006298721	Bonus Cap su UBI Banca	14,3186	14,1604	Not Applicable*	Not Applicable*	15,7504	15,5763	29/10/2009

* La barriera dello strumento è già stata toccata.

Le rettifiche avranno efficacia a far data dal 22 Giugno 2009.