



Borsa Italiana

AVVISO n.10636	06 Giugno 2014	SeDeX - PLAIN VANILLA
---------------------------------	----------------	--------------------------

Mittente del comunicato : UNICREDIT

Societa' oggetto
dell'Avviso : UNICREDIT

Oggetto : Securitised Derivatives - Rettifica Strike
Price e Parità

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 9/6/2014 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

b

Spettabile
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza Affari, 6
20123 Milano

Milano, 06.06.2014

OGGETTO: RETTIFICA DI COVERED WARRANTS EMESSI DA UNICREDIT S.P.A. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:

In seguito a delibera dell'Assemblea Straordinaria dei soci di Banca Monte Paschi di Siena S.p.A del 5 Giugno 2014, a partire dal 9 Giugno 2014 sarà effettivo l'aumento a pagamento del capitale mediante offerta in opzione agli aventi diritto di azioni ordinarie, con un rapporto di sottoscrizione di 214 azioni di nuova emissione BMPS ogni 5 azioni BMPS possedute al prezzo di sottoscrizione di 1 euro, come si evince dagli avvisi MTA n.10491 del 5.06.2014 e n. 10607 del 6.06.2014.

Al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori in Covered Warrants, in conformità alle modalità di rettifica previste dal mercato IDEM (avviso n 10501 del 05.06.2014), i Covered Warrants emessi da UniCredit S.p.a. con sottostante Banca Monte Dei Paschi di Siena saranno rettificati in base al coefficiente di rettifica K pari a 0,062489 pubblicato dal IDEM (si vede del avviso n.10631 del 06.06.2014), come indicato nella Tabella 1. La rettifica è efficace a partire dal 9 Giugno 2014.

- **Data di efficacia** 9 Giugno 2014
- **Codice ISIN dell'azione sottostante Banca Monte Dei Paschi di Siena S.p.A.:** IT0004984842
- **Mercato di riferimento:** IDEM
- **Caratteristiche dei Certificati ante e post rettifica in forma tabellare:** si veda in allegato la Tabella 1

UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
20121 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.it

UniCredit S.p.A. - Sede Sociale: ROMA Via
A. Specchi, 16- Direzione Generale: MILANO
Piazza Cordusio, iscrizione al Registro delle
Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA
n° 00348170101, iscritta all'Albo delle Banche
e capogruppo del Gruppo Bancario UniCredit,
Albo dei Gruppi Bancari: cod.3135.1 -
Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei
Depositi - capitale sociale €
19.654.856.199,43, interamente versato.

Tabella 1:

Codice ISIN	Tipologia	Call/Put	Scadenza	Sottostante	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Multiplo	Nuovo Multiplo
IT0004993819	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	40	2,4996	0,001	0,016
IT0004945850	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	25	1,5622	0,001	0,016
IT0004993777	Covered Warrant	Put	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	16	0,9998	0,001	0,016
IT0004993736	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	28	1,7497	0,001	0,016
IT0004945876	Covered Warrant	Put	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	25	1,5622	0,001	0,016
IT0004972755	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	30	1,8747	0,001	0,016
IT0004993686	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	16	0,9998	0,001	0,016
IT0004993694	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	18	1,1248	0,001	0,016
IT0004993751	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	34	2,1246	0,001	0,016
IT0004993769	Covered Warrant	Put	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	12	0,7499	0,001	0,016

UniCredit S.p.A.

UniCredit S.p.A. - Sede Sociale: ROMA Via A. Specchi, 16- Direzione Generale: MILANO Piazza Cordusio, iscrizione al Registro delle Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA n° 00348170101, iscritta all'Albo delle Banche e capogruppo del Gruppo Bancario UniCredit, Albo dei Gruppi Bancari: cod.3135.1 - Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei Depositi - capitale sociale € 19.654.856.199,43, interamente versato.

Via San Protaso, 3
20121 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.it

IT0004945868	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	35	2,1871	0,001	0,016
IT0004972730	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	25	1,5622	0,001	0,016
IT0004993702	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	23	1,4372	0,001	0,016
IT0004993843	Covered Warrant	Put	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	20	1,2498	0,001	0,016
IT0004945827	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	20	1,2498	0,001	0,016
IT0004945843	Covered Warrant	Put	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	20	1,2498	0,001	0,016
IT0005007635	Covered Warrant	Put	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	30	1,8747	0,001	0,016
IT0004945835	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	30	1,8747	0,001	0,016
IT0004972748	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	20	1,2498	0,001	0,016

Data di efficacia: 09 Giugno 2014

Cordiali saluti,
UniCredit S.p.A.
UniCredit S.p.A.

Via San Protaso, 3
 20121 Milano MI
 Tel. 02.88621
 e-mail info@unicredit.it

UniCredit S.p.A. - Sede Sociale: ROMA Via A. Specchi, 16- Direzione Generale: MILANO Piazza Cordusio, iscrizione al Registro delle Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA n° 00348170101, iscritta all'Albo delle Banche e capogruppo del Gruppo Bancario UniCredit, Albo dei Gruppi Bancari: cod.3135.1 - Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei Depositi - capitale sociale € 19.654.856.199,43, interamente versato.