

AVVISO n.9459	29 Maggio 2009	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 1/6/2009 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

Spett.le
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza degli Affari, 6
MILANO

Milano, 29.05.2009

Oggetto: effetti dell'aumento a pagamento del capitale sociale attuato mediante offerta in opzione agli azionisti di azioni ordinarie della società Enel S.p.A., sui covered warrant emessi da UniCredit sulle azioni ENEL (IT0003128367).

La società ENEL S.p.A. ha deliberato un aumento a pagamento del capitale sociale di 13 nuove azioni ordinarie ENEL (ISIN IT0003128367) ogni 25 azioni vecchie possedute (si veda Avviso di Borsa Italiana n. 9427 del 29.05.2009). A partire dal 01.06.2009 si rende pertanto necessario rettificare i covered warrant emessi da UniCredit sulle azioni ENEL al fine di mantenere invariata la posizione finanziaria dei portatori di tali titoli.

Pertanto, in linea con le modalità di intervento adottate sul mercato IDEM (si veda Avviso del mercato IDEM n. 9439 del 29.05.2009) e sulla base di quanto previsto dai prospetti relativi agli strumenti finanziari in oggetto, a partire dal 01.06.2009:
gli strike dei covered warrant di UniCredit su ENEL saranno rettificati moltiplicando i valori correnti per il coefficiente di rettifica K mentre il multiplo di tutti gli strumenti sarà diviso per il coefficiente di rettifica K, con K pari a:

$$\text{Coefficiente di rettifica } K = 0,881498$$

così come reso noto in giornata odierna dal mercato IDEM di Borsa Italiana alla chiusura delle negoziazioni.

Nella tabella 1 sono riportate le specifiche dei covered warrant aggiornati a seguito della rettifica; gli effetti della rettifica saranno efficaci a partire dal 01.06.2009.

UniCredito 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 € 8.389.215.286,50,
nteramente versato.

Tabella 1 - covered warrant di UniCredit

ISIN	Sottostante	ISIN sottostante	Tipo	Scadenza	Strike	Nuovo Strike	Multi plo	Nuovo Multiplo
IT0004355688	ENEL	IT0003128367	Call	04/12/2009	7,0	6,1705	0.1	0,1134
IT0004355696	ENEL	IT0003128367	Call	04/12/2009	9,0	7,9335	0.1	0,1134
IT0004425127	ENEL	IT0003128367	Call	05/06/2009	5,0	4,4075	0.1	0,1134
IT0004425135	ENEL	IT0003128367	Call	05/06/2009	6,0	5,2890	0.1	0,1134
IT0004425143	ENEL	IT0003128367	Call	05/06/2009	7,0	6,1705	0.1	0,1134
IT0004425150	ENEL	IT0003128367	Put	05/06/2009	5,0	4,4075	0.1	0,1134
IT0004429715	ENEL	IT0003128367	Put	05/06/2009	4,0	3,5260	0.1	0,1134
IT0004443021	ENEL	IT0003128367	Call	05/06/2009	4,0	3,5260	0.1	0,1134
IT0004443039	ENEL	IT0003128367	Put	05/06/2009	3,5	3,0852	0.1	0,1134
IT0004477417	ENEL	IT0003128367	Call	04/09/2009	3,0	2,6445	0.1	0,1134
IT0004477425	ENEL	IT0003128367	Call	04/09/2009	3,7	3,2615	0.1	0,1134
IT0004477433	ENEL	IT0003128367	Call	04/09/2009	4,4	3,8786	0.1	0,1134
IT0004477441	ENEL	IT0003128367	Call	04/09/2009	5,2	4,5838	0.1	0,1134
IT0004477458	ENEL	IT0003128367	Put	04/09/2009	4,0	3,5260	0.1	0,1134
IT0004477466	ENEL	IT0003128367	Put	04/09/2009	3,3	2,9089	0.1	0,1134
IT0004477474	ENEL	IT0003128367	Put	04/09/2009	2,5	2,2037	0.1	0,1134

Distinti saluti,

UniCredit S.p.A.

UniCredito 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 € 8.389.215.286,50,
nteramente versato.