

AVVISO n.9152	20 Maggio 2011	SeDeX – PLAIN VANILLA
----------------------	-----------------------	----------------------------------

Mittente del comunicato : UNICREDIT
Societa' oggetto dell'Avviso : UNICREDIT
Oggetto : Securitised Derivatives – Rettifiche Strike Price e Parità

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 23/5/2011 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

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

Milano, 20.05.2011

Oggetto: avviso di rettifica di covered warrant legati alle azioni AZIMUT HOLDING (IT0003261697) emessi da UniCredit in seguito alla distribuzione di un dividendo straordinario.

A seguito della distribuzione di un dividendo totale pari a 0,25€ per azione, con la componente ordinaria pari a 0,10 € e un dividendo aggiuntivo pari a 0,15 € ai portatori delle azioni AZIMUT HOLDING (IT0003261697) si vedano Avvisi di Borsa numero 3466 del 10 Marzo 2011 e numero 7191 del 29 Aprile 2011, UniCredit in qualità di emittente dei covered warrant, sulla base di quanto previsto dal regolamento degli stessi, intende rettificare, in conformità alle modalità di rettifica previste dal mercato IDEM, i covered warrant emessi da UniCredit sulle azioni AZIMUT HOLDING al fine di mantenere invariata la posizione finanziaria dei portatori di tali titoli.

Pertanto a partire dal 23.05.2011:

- gli strike dei covered warrant di UniCredit su AZIMUT HOLDING saranno rettificati moltiplicando i valori correnti per il coefficiente di rettifica K, come determinato dal mercato IDEM, mentre il multiplo di tutti gli strumenti sarà diviso per il coefficiente di rettifica K, con K pari a:

$$\text{Coefficiente di rettifica } K = 0,980455$$

Nella tabella 1 sono riportate le specifiche dei covered warrant aggiornati a seguito della rettifica; gli effetti della rettifica saranno efficaci a partire dal 23.05.2011.

Tabella 1 - covered warrant di UniCredit

ISIN	Sottostante	ISIN sottostante	Tipo	Scadenza	Strike	Nuovo Strike	Multiplo	Nuovo Multiplo
IT0004663875	AZIMUT HOLDING	IT0003261697	Put	03/06/2011	6,5	6,3730	0.1	0,1020
IT0004663859	AZIMUT HOLDING	IT0003261697	Call	03/06/2011	7	6,8632	0.1	0,1020
IT0004663867	AZIMUT HOLDING	IT0003261697	Call	03/06/2011	8	7,8436	0.1	0,1020
IT0004704307	AZIMUT HOLDING	IT0003261697	Put	02/09/2011	6,8	6,6671	0.1	0,1020
IT0004683766	AZIMUT HOLDING	IT0003261697	Call	02/09/2011	7,5	7,3534	0.1	0,1020
IT0004683782	AZIMUT HOLDING	IT0003261697	Put	02/09/2011	7,5	7,3534	0.1	0,1020
IT0004683774	AZIMUT HOLDING	IT0003261697	Call	02/09/2011	8,5	8,3339	0.1	0,1020

Distinti 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 € 9.649.245.346,50, interamente versato.