

AVVISO n.9153	20 Maggio 2011	SeDeX – PLAIN VANILLA
----------------------	-----------------------	----------------------------------

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

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 INTESA SANPAOLO (IT0000072618) emessi da UniCredit in seguito all'aumento a pagamento del capitale sociale di INTESA SANPAOLO attuato mediante offerta in opzione agli azionisti ordinari e di risparmio di azioni ordinarie

A seguito dell'aumento a pagamento del capitale sociale di INTESA SANPAOLO attuato mediante offerta in opzione agli azionisti ordinari e di risparmio, al prezzo di euro 1,369 per azione, di 2 azioni ordinarie di nuova emissione per ogni 7 azioni possedute si veda Avviso di Borsa numero 9161 del 20 Maggio 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 Avviso numero x del 20 Maggio 2011, i covered warrant emessi da UniCredit sulle azioni INTESA SANPAOLO 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 INTESA SANPAOLO 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:

$$\text{Coefficiente di rettifica } K = \mathbf{0,937878}$$

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
IT0004499601	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	02.12.2011	2	1,8758	0,1	0,1066
IT0004499619	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.12.2011	2,5	2,3447	0,1	0,1066
IT0004499627	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.12.2011	4	3,7515	0,1	0,1066
IT0004665318	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	03.06.2011	2	1,8758	0,1	0,1066
IT0004665326	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	03.06.2011	2,2	2,0633	0,1	0,1066
IT0004665334	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	03.06.2011	2,4	2,2509	0,1	0,1066
IT0004665342	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	03.06.2011	2,6	2,4385	0,1	0,1066
IT0004665359	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	03.06.2011	2,8	2,6261	0,1	0,1066
IT0004665367	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	03.06.2011	2,2	2,0633	0,1	0,1066
IT0004665375	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	03.06.2011	2	1,8758	0,1	0,1066

IT0004665383	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	03.06.2011	1,8	1,6882	0,1	0,1066
IT0004665391	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	03.06.2011	1,6	1,5006	0,1	0,1066
IT0004665409	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.12.2011	2	1,8758	0,1	0,1066
IT0004665417	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	02.12.2011	1,7	1,5944	0,1	0,1066
IT0004665425	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	07.12.2012	2,2	2,0633	0,1	0,1066
IT0004665433	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	07.12.2012	3	2,8136	0,1	0,1066
IT0004665441	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	07.12.2012	1,9	1,7820	0,1	0,1066
IT0004684905	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.09.2011	3,1	2,9074	0,1	0,1066
IT0004684913	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.09.2011	2,3	2,1571	0,1	0,1066
IT0004684921	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.09.2011	2,5	2,3447	0,1	0,1066
IT0004684939	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.09.2011	2,7	2,5323	0,1	0,1066
IT0004684947	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.09.2011	2,9	2,7198	0,1	0,1066
IT0004684954	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	02.09.2011	2,5	2,3447	0,1	0,1066
IT0004684962	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	02.09.2011	2,3	2,1571	0,1	0,1066
IT0004684970	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	02.09.2011	2,1	1,9695	0,1	0,1066
IT0004684988	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	02.09.2011	1,9	1,7820	0,1	0,1066
IT0004704786	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	07.12.2012	2,6	2,4385	0,1	0,1066
IT0004704794	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	07.12.2012	3,3	3,0950	0,1	0,1066
IT0004704802	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	07.12.2012	2,2	2,0633	0,1	0,1066
IT0004704810	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.12.2011	3	2,8136	0,1	0,1066
IT0004704828	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.12.2011	2,25	2,1102	0,1	0,1066
IT0004704836	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Call	02.12.2011	2,75	2,5792	0,1	0,1066
IT0004704844	INTESA SANPAOLO	IT0000072618	Put	02.12.2011	2,25	2,1102	0,1	0,1066

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.31351 -
Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei
Depositi - capitale sociale € 9.649.245.346,50,
interamente versato.