

AVVISO n.9968	03 Giugno 2011	SeDeX – PLAIN VANILLA
----------------------	-----------------------	----------------------------------

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

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 6/6/2011 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

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

Milano, 03.06.2011

Oggetto: avviso di rettifica di covered warrant legati alle azioni UBI Banca (IT0003487029).

A seguito dell'aumento a pagamento del capitale sociale di UBI Banca attuato mediante offerta in opzione agli azionisti ordinari e ai portatori di obbligazioni convertibili ("UBI 2009/2013 CONVERTIBILE CON FACOLTA' DI RIMBORSO IN AZIONI"), di 8 azioni ordinarie di nuova emissione per ogni 21 azioni e/o obbligazioni convertibili possedute si veda Avviso di Borsa numero 9855 del 02 Giugno 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 9920 del 02 Giugno 2011, i covered warrant emessi da UniCredit sulle azioni UBI Banca al fine di mantenere invariata la posizione finanziaria dei portatori di tali titoli.

Pertanto a partire dal 06.06.2011:

– gli strike dei covered warrant di UniCredit su UBI Banca 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:

Coefficiente di rettifica K = 0,936340

Nella tabella 1 sono riportate le specifiche dei covered warrant aggiornati a seguito della rettifica; gli effetti della rettifica saranno efficaci a partire dal 06.06.2011.

Tabella 1 - covered warrant di UniCredit

ISIN	Sottostante	ISIN sottostante	Tipo	Scadenza	Strike	Nuovo Strike	Multiplo	Nuovo Multiplo
IT0004685795	UBI Banca	IT0003487029	Call	02/09/2011	7.75	7.2566	0.1	0.1068
IT0004685803	UBI Banca	IT0003487029	Call	02/09/2011	8.5	7.9589	0.1	0.1068
IT0004685811	UBI Banca	IT0003487029	Call	02/09/2011	9.5	8.8952	0.1	0.1068
IT0004685829	UBI Banca	IT0003487029	Put	02/09/2011	7.75	7.2566	0.1	0.1068
IT0004685837	UBI Banca	IT0003487029	Put	02/09/2011	7	6.5544	0.1	0.1068
IT0004705080	UBI Banca	IT0003487029	Call	02/09/2011	7	6.5544	0.1	0.1068
IT0004705098	UBI Banca	IT0003487029	Put	02/09/2011	6.3	5.8989	0.1	0.1068

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.