

Spettabile EuroTLX SIM S.p.A.
Via Mazzini, 11
20123 Milano

Milano, 24 giugno 2014

OGGETTO: Rettifica dei *Certificates* emessi da UniCredit Bank AG su azioni Banca Monte dei Paschi di Siena

Facendo seguito all'avviso di Borsa Italiana n.11466 del 20 giugno 2014 relativo alla "rettifica dei *Certificates* emessi da UniCredit Bank AG su azioni Banca Monte dei Paschi di Siena – Aggiornamento", si indicano di seguito le modalità di determinazione del coefficiente di rettifica K applicate al fine di mantenere invariata, per quanto possibile, la posizione degli investitori in tali *Certificates*.

In data 27 giugno 2014 dopo la chiusura del mercato, le caratteristiche dei *Certificates* saranno rettificate (i) sostituendo il sottostante rappresentato da un paniere costituito da un'azione Banca Monte dei Paschi di Siena (IT0004984842) e da un diritto di opzione (IT0004984636) con una singola azione Banca Monte Paschi di Siena (IT0004984842) e (ii) modificando *Strike, Barriera* e Cap in base al coefficiente di rettifica K pari a 0,062489 comunicato dal mercato IDEM (si veda l'avviso di Borsa Italiana n.10631 del 6 giugno 2014), come indicato nella Tabella 1 che segue.

Si ricorda che fino al 27 giugno 2014, l'operatore specialista, UniCredit Bank AG, Milan Branch, utilizzerà per la determinazione delle proposte in acquisto e vendita aventi a oggetto i *Certificates*, una valorizzazione fissa dei diritti di opzione basata sull'ultimo prezzo di mercato del 20 giugno 2014.

Si segnala inoltre che l'eventuale modifica delle condizioni e/o del calendario dell'offerta come descritte negli avvisi di Borsa Italiana n.10491 del 5 giugno 2014 e n. 10607 del 6 giugno 2014 potrà richiedere ulteriori rettifiche alle caratteristiche dei *Certificates* al fine di mantenere invariata, per quanto possibile, la posizione degli investitori in tali *Certificates*.

UniCredit Bank A.G.

UniCredit Bank AG
Milan Branch

Piazza Gae Aulenti, 4 – Tower C
20154 Milan, Italy
Tel. +39 02 8862-1

Registered Office: Milan, Italy
Listed in the Banks' Register: ABI Code 03081.7
Tax Code, VAT Register and Italian Register
of Companies No. 09144100154

Board of Managing Directors:
Dr. Theodor Weimer (Board Spokesman),
Peter Buschbeck, Jürgen Danzmayr,
Lutz Diederichs, Peter Hofbauer,
Heinz Laber, Andrea Varese

Chairman of the Supervisory Board:
Federico Ghizzoni

Legal Status: Aktiengesellschaft
Capital Stock: EUR 2,407,151,016 fully paid-in
Registered Office: Munich, Germany
Listed in the Court Register: Munich HR B 421 48
Tax-Id.No.: 143/102/30007
VAT Reg.No.: DE 129 273 380

www.unicreditgroup.eu

UniCredit Group - INTERNAL USE ONLY -

Tabella 1:

Codice ISIN	Tipologia	Scadenza	Precedente Sottostante	Sottostante	Codice ISIN Sottostante	Precedente Strike	Nuovo Strike	Barriera %	Precedente Barriera	Nuova Barriera	Cap %	Precedente Cap	Nuovo Cap
DE000HV8A 2G0	Bonus Cap Certificate	20/06/2014	1 azione Banca Monte Paschi Siena ex diritto +1 diritto di acquisto di 42,8 azioni Banca Monte Paschi al prezzo di 1 € l'una	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	IT0001334588	21,62	1,351	70%	n.a	-*	115,5	24,9711	1,5604
DE000HV8A 240	Bonus Cap Certificate	14/08/2014	1 azione Banca Monte Paschi Siena ex diritto +1 diritto di acquisto di 42,8 azioni Banca Monte Paschi al prezzo di 1 € l'una	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	IT0001334588	23,27	1,4541	75%	n.a	-*	118,5	27,575	1,7231
DE000HV8A 8J1	Cash Collect	17/02/2017	1 azione Banca Monte Paschi Siena ex diritto +1 diritto di acquisto di 42,8 azioni Banca Monte Paschi al prezzo di 1 € l'una	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	IT0001334588	18,26	1,141	50%	9,13	0,57052457	n.a	n.a	n.a

*La barriera è stata toccata

Data di efficacia: 09.06.2014

Cordiali Saluti
UniCredit Bank AG