

Informazione Regolamentata n. 0263-84-2015	Data/Ora Ricezione 01 Aprile 2015 15:49:30	MTA
--	---	-----

Societa' : UNICREDIT
Identificativo : 55683
Informazione
Regolamentata
Nome utilizzatore : UNICREDITN11 - Turconi
Tipologia : AVVI 16
Data/Ora Ricezione : 01 Aprile 2015 15:49:30
Data/Ora Inizio : 01 Aprile 2015 16:04:31
Diffusione presunta
Oggetto : Scadenza Anticipata Covered Warrant
UniCredit S.p.A. con sottostante Gtech
S.p.A.

Testo del comunicato

Vedi allegato.

**Spettabile
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza Affari, 6
20123 Milano**

Milano, 1 aprile 2015

OGGETTO: SCADENZA ANTICIPATA DEI COVERED WARRANT CON SOTTOSTANTE GTECH S.P.A. EMESSI DA UNICREDIT S.P.A. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

- Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:

Con riferimento a:

- avviso di UniCredit S.p.A. pubblicato in data 23 marzo 2015 con oggetto "EVENTO RILEVANTE CON POSSIBILE SCADENZA ANTICIPATA DEI COVERED WARRANT CON SOTTOSTANTE GTECH S.P.A. EMESSI DA UNICREDIT S.P.A. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA"

- **avviso MTA n. 5242 del 01.04.2015**

- avvisi IDEM n. 17651 del 17.10.2014 e n. 4061 del 18.03.2015 ed avvisi di Borsa Italiana n. 13077 del 16.07.2014 e n.3921 del 17.03.2015

in seguito a:

- esito positivo delle condizioni sospensive e conferma in data odierna di Gtech S.p.A. del perfezionamento dell'operazione di fusione di Gtech S.p.A. in International Game Technology plc

- relativa revoca dalle negoziazioni su Borsa Italiana delle azioni ordinarie Gtech S.p.A. con efficacia dal 7 aprile 2015,

UniCredit S.p.A.

in qualità di Emittente dei Covered Warrant con sottostante Gtech S.p.A. elencati in Tabella 1 (i "Covered Warrant"), in accordo con l'Agente per il Calcolo, ai sensi dell'articolo 2.2.3.3 del Prospetto di Base, conferma ai portatori dei **Covered Warrant** che essi **scadranno anticipatamente e si estingueranno a far data dalla data di revoca del sottostante Gtech S.p.A. (7 aprile 2015)**.

Come annunciato in data 23 marzo 2015, per il calcolo dell'Importo di liquidazione dei Covered Warrant verrà applicata la metodologia del Theoretical Fair Value (TFV) analogamente a quanto applicato dal relativo Mercato Correlato IDEM.

UniCredit S.p.A.

Piazza Gae Aulenti, 3
20124 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 Gae Aulenti 3 - Tower A, 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 € 19.905.773.742,24, interamente versato.

Tale metodologia tiene in considerazione le seguenti variabili:

Data di Valutazione: ultimo giorno di negoziazione (2 aprile 2015)

Prezzo di Riferimento: "prezzo di riferimento" del Sottostante alla Data di Valutazione, fatto salvo il verificarsi di un Evento di Turbativa

Tassi di interesse: tasso di interesse basato sulla curva Euribor, coerente con la vita residua del contratto, rilevato nel giorno antecedente la chiusura e liquidazione dei contratti di opzione

Dividendi attesi: nulli (fonte: Bloomberg)

Volatilità: a differenza del Mercato Correlato IDEM, ai fini del calcolo del TFV si utilizza la volatilità implicita dei singoli Covered Warrant rilevata alla Data di Valutazione

Data di Pagamento: cinque giorni bancari successivi alla Data di Valutazione (13 aprile 2015)

Tabella 1:

Codice ISIN	Tipologia	Call/Put	Strike	Sottostante	Scadenza	Scadenza Anticipata
IT0005050585	Covered Warrant	Call	16	Gtech S.p.A.	05/06/2015	07/04/2015
IT0005079675	Covered Warrant	Call	18	Gtech S.p.A.	05/06/2015	07/04/2015
IT0005035081	Covered Warrant	Call	20	Gtech S.p.A.	05/06/2015	07/04/2015
IT0005079683	Covered Warrant	Put	16	Gtech S.p.A.	05/06/2015	07/04/2015
IT0005079709	Covered Warrant	Call	18	Gtech S.p.A.	04/09/2015	07/04/2015
IT0005079717	Covered Warrant	Call	16	Gtech S.p.A.	04/12/2015	07/04/2015
IT0005079725	Covered Warrant	Call	20	Gtech S.p.A.	04/12/2015	07/04/2015
IT0005079758	Covered Warrant	Call	18	Gtech S.p.A.	04/03/2016	07/04/2015
IT0005079766	Covered Warrant	Call	20	Gtech S.p.A.	04/03/2016	07/04/2015

- Data di efficacia: la revoca dalle quotazioni di Gtech S.p.A. sarà efficace il 7 aprile 2015
- Codice ISIN dell'azione sottostante: Gtech S.p.A. (ISIN IT0003990402)
- Mercato dei derivati di riferimento: IDEM

Cordiali saluti,
UniCredit SpA



(legale rappresentante)



(legale rappresentante)

UniCredit S.p.A.

Piazza Gae Aulenti, 3
20124 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 Gae Aulenti 3 - Tower A, iscrizione al Registro delle Imprese di Roma, codice fiscale e partita IVA n° 00548170101, 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 € 19.905.773.742,24, interamente versato.

Fine Comunicato n.0263-84

Numero di Pagine: 4