

# Bit Market Services

Informazione Regolamentata n. 0263-396-2015	Data/Ora Ricezione 30 Dicembre 2015 18:12:31	MTA
---	--	-----

Societa' : UNICREDIT  
Identificativo : 67555  
Informazione  
Regolamentata  
Nome utilizzatore : UNICREDITN11 - Turconi  
Tipologia : AVVI 16  
Data/Ora Ricezione : 30 Dicembre 2015 18:12:31  
Data/Ora Inizio : 30 Dicembre 2015 18:27:32  
Diffusione presunta  
Oggetto : Rettifica Covered Warrant di UniCredit con  
sottostante FIAT-FCA

*Testo del comunicato*

Vedi allegato.

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

Milano, 30 Dicembre 2015

**OGGETTO: RETTIFICA DI COVERED WARRANT EMESSI DA UNICREDIT S.P.A. A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA**

- **Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:**

L'Assemblea straordinaria degli azionisti Fiat Chrysler Automobiles N.V. (in breve FIAT-FCA) ha approvato la scissione di Ferrari N.V. da Fiat Chrysler Automobiles N.V., che costituisce parte di una serie di operazioni volte ad effettuare la separazione.

In particolare, è prevista:

- la scissione parziale di Fiat Chrysler Automobiles N.V. a favore di FE Interim B.V. ("Prima Scissione")
- la scissione parziale di FE Interim B.V. a favore di FE New N.V. ("Seconda Scissione")
- il rimborso al valore nominale delle azioni FE INTERIM B.V. e la fusione di Ferrari N.V. in FE New N.V. che assumerà la denominazione di FERRARI N.V.
- l'assegnazione di n. 1 azione ordinaria FERRARI N.V. (già FE New N.V.) per ogni n. 10 azioni ordinarie FE Interim B.V. (assegnate agli azionisti ordinari di FIAT-FCA per effetto della Prima Scissione) + Euro 0,01 a titolo di rimborso del valore nominale per ogni n. 1 azione FE Interim B.V. ritirata e annullata.

Si prevede che tali operazioni abbiano luogo tra il 31 dicembre 2015 ed il 3 gennaio 2016 e che i possessori delle azioni e delle obbligazioni a conversione obbligatoria di FIAT-FCA siano in grado di negoziare le proprie azioni Ferrari N.V., subordinatamente al completamento della separazione ed autorizzazione delle competenti Autorità di Vigilanza, a partire dal 4 gennaio 2016, data di inizio negoziazione di Ferrari N.V. sul mercato MTA di Borsa Italiana (si veda l'avviso di Borsa Italiana n. 21127 del 15 dicembre 2015 e avviso IDEM n. 21128 del 15 dicembre 2015).

Al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Covered Warrant emessi da UniCredit S.p.A., **subordinatamente alla conclusione dell'iter autorizzativo e al perfezionamento dell'operazione (di cui sarà data conferma mediante avviso di Borsa Italiana entro le 7:59 di lunedì 4 gennaio 2016)** sono previste due principali rettifiche, in linea con le modalità di rettifica del mercato dei derivati IDEM:

- il sottostante Fiat Chrysler Automobiles è sostituito da un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146), come indicato nella Tabella 1.
- i valori di Strike e Multiplo vengono rettificati come indicato in Tabella 1, in base al coefficiente di rettifica determinato e pubblicato da IDEM al termine delle contrattazioni in data 30 dicembre 2015, pari a 0.999226.

Tali rettifiche sono efficaci dal 4 Gennaio 2016, subordinatamente al verificarsi delle condizioni sopracitate.

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.

- **Data di efficacia:** 4 Gennaio 2016 (subordinatamente alla conclusione dell'iter autorizzativo e al perfezionamento dell'operazione)
- **Coefficiente di rettifica:** 0.999226
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** il sottostante (ovvero il componente il paniere ove applicabile) Fiat Chrysler Automobiles N.V. è sostituito da un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Caratteristiche dei certificates/cw ante e post rettifica in forma tabellare:**  
si veda Tabella 1

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.

**Tabella 1:**

ISIN	Tipologia	Call/Put	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Multiplo	Nuovo Multiplo	Scadenza	Precedente Sottostante	Nuovo Sottostante
IT0005079360	Covered Warrant	Call	10	9.9923	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005079378	Covered Warrant	Call	12	11.9907	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005113656	Covered Warrant	Call	13	12.9899	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005079386	Covered Warrant	Call	14	13.9892	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005113672	Covered Warrant	Call	15	14.9884	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103343	Covered Warrant	Call	16	15.9876	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005113698	Covered Warrant	Call	17	16.9868	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103350	Covered Warrant	Call	18	17.9861	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.

IT0005113714	Covered Warrant	Call	19	18.9853	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103368	Covered Warrant	Call	20	19.9845	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103376	Covered Warrant	Call	22	21.983	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005079394	Covered Warrant	Put	8	7.9938	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005079402	Covered Warrant	Put	10	9.9923	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103384	Covered Warrant	Put	12	11.9907	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103400	Covered Warrant	Put	16	15.9876	0.1	0.1001	04/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005150518	Covered Warrant	Call	13.5	13.4896	0.1	0.1001	17/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005150534	Covered Warrant	Call	14.5	14.4888	0.1	0.1001	17/03/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005113730	Covered Warrant	Call	14	13.9892	0.1	0.1001	03/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.

IT0005103418	Covered Warrant	Call	16	15.9876	0.1	0.1001	03/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103426	Covered Warrant	Call	18	17.9861	0.1	0.1001	03/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103434	Covered Warrant	Call	20	19.9845	0.1	0.1001	03/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103442	Covered Warrant	Call	22	21.983	0.1	0.1001	03/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005113755	Covered Warrant	Put	8	7.9938	0.1	0.1001	03/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005103467	Covered Warrant	Put	14	13.9892	0.1	0.1001	03/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005133878	Covered Warrant	Call	12	11.9907	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005156945	Covered Warrant	Call	12.5	12.4903	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005156952	Covered Warrant	Call	13.5	13.4896	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005156960	Covered Warrant	Call	14.5	14.4888	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.

IT0005156978	Covered Warrant	Call	15.5	15.488	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005156986	Covered Warrant	Call	16.5	16.4872	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005156994	Covered Warrant	Put	11	10.9915	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005157000	Covered Warrant	Put	13	12.9899	0.1	0.1001	16/06/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005133894	Covered Warrant	Call	12	11.9907	0.1	0.1001	15/09/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005133936	Covered Warrant	Call	16	15.9876	0.1	0.1001	15/09/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005133951	Covered Warrant	Call	18	17.9861	0.1	0.1001	15/09/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005133977	Covered Warrant	Put	10	9.9923	0.1	0.1001	15/09/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005133993	Covered Warrant	Put	12	11.9907	0.1	0.1001	15/09/2016	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)
IT0005018459	Covered Warrant	Call	10	9.9923	0.1	0.1001	01/12/2017	Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)	un paniere composto da: un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.



Per completezza, di seguito le informazioni sui componenti il paniere:

Componente il Paniere	Codice ISIN	Codice Reuters	Codice Bloomberg
Fiat Chrysler Automobiles N.V.	NL0010877643	FCHA.MI	FCA IM Equity
Ferrari N.V.	NL0011585146	RAC.MI	RACE IM Equity

Data di efficacia della rettifica: 4 gennaio 2016 (subordinatamente alla conclusione dell'iter autorizzativo e al perfezionamento dell'operazione)

Cordiali saluti,  
**UniCredit S.p.A.**

**UniCredit S.p.A.**

Piazza Gae Aulenti, 3  
20124 Milano MI  
Tel. 02.88621  
e-mail [info@unicredit.it](mailto: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.



Fine Comunicato n.0263-396

Numero di Pagine: 9