

Bit Market Services

| | | |
|-------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------|
| Informazione Regolamentata n. 0278-2-2017 | Data/Ora Ricezione 03 Febbraio 2017 17:58:29 | SeDeX - INV. CERTIFICATES |
|-------------------------------------------------|----------------------------------------------------|------------------------------|

Societa' : BANCA IMI
Identificativo : 84763
Informazione
Regolamentata
Nome utilizzatore : BANCAIMINSS01 - R
Tipologia : AVVI 16
Data/Ora Ricezione : 03 Febbraio 2017 17:58:29
Data/Ora Inizio : 03 Febbraio 2017 18:20:07
Diffusione presunta
Oggetto : Rettifica CW e Certificates emessi da
Banca Imi

Testo del comunicato

Vedi allegato.

Milano, 03/02/2017

OGGETTO: RETTIFICA DI COVERED WARRANT E CERTIFICATES EMESSI DA BANCA IMI A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

- **Descrizione dell'EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA:** UNICREDIT S.p.A. - Aumento a pagamento del capitale sociale mediante offerta in opzione agli azionisti ordinari e di risparmio di azioni ordinarie UNICREDIT (ISIN: IT0005239360) in ragione di n. 13 nuove azioni ordinarie ogni n. 5 azioni ordinarie e/o di risparmio possedute al prezzo di sottoscrizione di Euro 8.09 cad. – ex date: 06/02/2017 (come da Avvisi di Borsa Italiana - MTA n. 2001 del 2 Febbraio 2017 e n. 2075 del 3 Febbraio 2017).
- **Data di efficacia:** 06/02/2017
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** IT0005239360
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM – Borsa Italiana
- **Coefficiente di Rettifica:** 0.501126 (calcolato come da Avviso di Borsa Italiana - Idem n. 2003 del 2 Febbraio 2017).
- **Caratteristiche dei Covered Warrant ante e post rettifica in forma tabellare:**

| ISIN | Sottostante | Tipo | Vecchio strike | Vecchio Multiplo | Nuovo Strike | Nuovo Multiplo |
|--------------|-------------|------|----------------|------------------|--------------|----------------|
| IT0005174096 | Unicredit | Call | 56.000 | 0.010 | 28.0630 | 0.019955 |
| IT0005174104 | Unicredit | Call | 50.000 | 0.010 | 25.0563 | 0.019955 |
| IT0005174112 | Unicredit | Call | 55.000 | 0.010 | 27.5619 | 0.019955 |
| IT0005201527 | Unicredit | Call | 35.000 | 0.010 | 17.5394 | 0.019955 |
| IT0005201535 | Unicredit | Call | 40.000 | 0.010 | 20.0450 | 0.019955 |
| IT0005201543 | Unicredit | Call | 38.000 | 0.010 | 19.0427 | 0.019955 |
| IT0005214298 | Unicredit | Call | 26.000 | 0.010 | 13.0292 | 0.019955 |
| IT0005214306 | Unicredit | Call | 27.000 | 0.010 | 13.5304 | 0.019955 |
| IT0005214314 | Unicredit | Call | 29.000 | 0.010 | 14.5326 | 0.019955 |
| IT0005214322 | Unicredit | Call | 28.000 | 0.010 | 14.0315 | 0.019955 |
| IT0005214330 | Unicredit | Call | 30.000 | 0.010 | 15.0337 | 0.019955 |
| IT0005214348 | Unicredit | Call | 28.000 | 0.010 | 14.0315 | 0.019955 |
| IT0005214355 | Unicredit | Call | 30.000 | 0.010 | 15.0337 | 0.019955 |
| IT0005224636 | Unicredit | Call | 23.000 | 0.010 | 11.5258 | 0.019955 |
| IT0005224644 | Unicredit | Call | 24.000 | 0.010 | 12.0270 | 0.019955 |

Banca IMI S.p.A. Sede Legale Largo Mattioli, 3 20121 Milano Capitale Sociale Euro 962.464.000,00 Registro Imprese di Milano, Codice Fiscale e Partita IVA 04377700150 N. Iscr. Albo delle Banche al n. 5570 Codice ABI 3249.0 Aderente al Fondo Interbancario di Tutela dei Depositi Società soggetta all'attività di Direzione e Coordinamento del socio unico Intesa Sanpaolo S.p.A. ed appartenente al gruppo bancario "Intesa Sanpaolo".

| | | | | | | |
|--------------|-----------|------|--------|-------|---------|----------|
| IT0005224651 | Unicredit | Call | 25.000 | 0.010 | 12.5281 | 0.019955 |
| IT0005224669 | Unicredit | Call | 25.000 | 0.010 | 12.5281 | 0.019955 |

- **Caratteristiche dei Certificates ante e post rettifica in forma tabellare:**

| ISIN | Sottostante | Vecchio strike | Vecchio Multiplo | Vecchia Barriera | Vecchio Livello di Protezione | Vecchio livello digitale | Nuovo strike | Nuovo Multiplo | Nuova Barriera | Nuovo Livello di Protezione | Nuovo livello digitale |
|--------------|-------------|----------------|------------------|------------------|-------------------------------|--------------------------|--------------|----------------|----------------|-----------------------------|------------------------|
| XS1379330639 | Unicredit | 27.980 | 35.73981 | 27.980 | 23.7830 | 27.980 | 14.0215 | 71.31902 | 14.0215 | 11.9183 | 14.0215 |

| ISIN | Sottostante | Vecchio strike | Vecchio Multiplo | Vecchia Barriera | Nuovo strike | Nuovo Multiplo | Nuova Barriera |
|--------------|-------------|----------------|------------------|------------------|--------------|----------------|----------------|
| XS1322969871 | Unicredit | 53.750 | 18.60465 | 36.550 | 26.9355 | 37.12570 | 18.3162 |
| XS1428019738 | Unicredit | 25.420 | 39.33910 | 17.7940 | 12.7386 | 78.50142 | 8.9170 |
| XS1518611642 | Unicredit | 22.880 | 43.70629 | 13.7280 | 11.4658 | 87.21618 | 6.8795 |
| XS1523066444 | Unicredit | 19.840 | 50.40323 | 16.8640 | 9.9423 | 100.5799 | 8.4510 |
| IT0005239709 | Unicredit | 26.180 | 3.81971 | 20.9440 | 13.1195 | 7.622254 | 10.4956 |

- **DATA DI EFFICACIA DELLA RETTIFICA:** 06/02/2017

Distinti saluti
Banca IMI S.p.A.

Fine Comunicato n.0278-2

Numero di Pagine: 4