

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

Milano, 9 giugno 2014

OGGETTO: RETTIFICA DI COVERED WARRANTS EMESSI DA UNICREDIT S.P.A. SU AZIONI BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA A SEGUITO DEL VERIFICARSI DI UN EVENTO RILEVANTE

Descrizione dell'Evento Rilevante:

In seguito dell'aumento di capitale a pagamento deliberato dall'Assemblea Straordinaria dei soci di Banca Monte Paschi di Siena S.p.A del 5 giugno 2014, l'Emittente ha posto in essere una prima rettifica ai *Covered Warrants* aventi come sottostante il titolo azionario Banca Monte dei Paschi di Siena (IT0004984842) in conformità alle modalità di rettifica previste dal mercato IDEM (cfr. avviso n. 10501 del 5 giugno 2014) in data 6 giugno 2014.

Alla luce dell'andamento del titolo azionario Banca Monte dei Paschi di Siena in data 9 giugno 2014 e al fine di mantenere invariata, per quanto possibile, la posizione degli investitori in tali *Covered Warrants*, l'Emittente ha apportato un'ulteriore rettifica alle caratteristiche degli stessi *Covered Warrants* ai sensi dell'articolo 2.3.3 del Regolamento dei Titoli, sostituendo il sottostante Banca Monte dei Paschi di Siena con un paniere costituito da una azione Banca Monte dei Paschi di Siena (IT0004984842) e un diritto di opzione (IT0004984636) e riportando *Strike* e *Multipli* al rispettivo valore antecedente la prima rettifica.

Entro il 30 giugno 2014, le caratteristiche e il sottostante dei *Covered Warrants* subiranno un'ulteriore rettifica per tenere conto del termine per l'esercizio del diritto di opzione e al fine di mantenere invariata, per quanto possibile, la posizione degli investitori in tali *Covered Warrants*.

I termini con la lettera maiuscola avranno il significato loro attribuito nell'Allegato al Regolamento dei Titoli.

- **Data di** efficacia: 10 giugno 2014

- **Caratteristiche dei Covered Warrant ante e post rettifica in forma tabellare:** si veda in allegato la Tabella 1
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 €
19.654.856.199,43, interamente versato.

Tabella 1

Codice ISIN	Tipologia	Call/Put	Scadenza	Vecchio Sottostante	Nuovo Sottostante	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Multiplo	Nuovo Multiplo
IT0004993819	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	2,4996	40	0,016	0,001
IT0004945850	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,5622	25	0,016	0,001
IT0004993777	Covered Warrant	Put	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	0,9998	16	0,016	0,001
IT0004993736	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,7497	28	0,016	0,001
IT0004945876	Covered Warrant	Put	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,5622	25	0,016	0,001
IT0004972755	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,8747	30	0,016	0,001

UniCredit S.p.A.

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 € 19.654.856.199,43, interamente versato.

 Via San Protaso, 3
 20121 Milano MI
 Tel. 02.88621
 e-mail info@unicredit.it

IT0004993686	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	0,9998	16	0,016	0,001
IT0004993694	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,1248	18	0,016	0,001
IT0004993751	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	2,1246	34	0,016	0,001
IT0004993769	Covered Warrant	Put	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	0,7499	12	0,016	0,001
IT0004945868	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	2,1871	35	0,016	0,001
IT0004972730	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,5622	25	0,016	0,001
IT0004993702	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,4372	23	0,016	0,001

UniCredit S.p.A.

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 € 19.654.856.199,43, interamente versato.

Via San Protaso, 3
20121 Milano MI
Tel. 02.88621
e-mail info@unicredit.it

IT0004993843	Covered Warrant	Put	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,2498	20	0,016	0,001
IT0004945827	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,2498	20	0,016	0,001
IT0004945843	Covered Warrant	Put	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,2498	20	0,016	0,001
IT0005007635	Covered Warrant	Put	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,8747	30	0,016	0,001
IT0004945835	Covered Warrant	Call	05/09/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,8747	30	0,016	0,001
IT0004972748	Covered Warrant	Call	05/12/2014	Banca Monte dei Paschi di Siena s.p.A.	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	1,2498	20	0,016	0,001

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 € 19.654.856.199,43, interamente versato.