

Avviso agli Investitori

relativo ai Certificati

Cash Collect Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. 17/02/2017

con ISIN DE000HV8A8J1

(i “Certificati”)

Premesso:

- Aumento di capitale di Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. (IT0005218752), si vedano avvisi di Borsa Italiana n. 23565 del 16.12.2016, n. 24251 del 27.12.2016, n.24294 e n.24343 del 27.12.2016, n.1132 del 23.01.2017 e n.1420 del 26.01.2017
- Delibere Consob n. 19833 del 22.12.2016 e n. 19840 del 23.12.2016 con oggetto “Sospensione temporanea delle negoziazioni nei mercati regolamentati, nei sistemi multilaterale di negoziazione e nei sistemi di internalizzazione sistematica italiani relativamente ai titoli emessi o garantiti da Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. e agli strumenti finanziari aventi come sottostante titoli emessi da Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.”
- Avvisi di EuroTLX n. 744 del 23.12.2016 e n.747 del 27.12.2016 con oggetto “Trading suspension Banca Monte dei Paschi di Siena”

UniCredit Bank AG, in qualità di Emittente, informa gli investitori dei certificati con ISIN DE000HV8A8J1 (i “Certificati”) che la sospensione dell’Azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. nella Borsa Rilevante alla Data di Valutazione e Data di Valutazione dell’Importo Addizionale dei Certificati (16 febbraio 2017) costituisce un **“Evento di Turbativa”** ai sensi dell’articolo 4.5 del Prospetto di Base dei Certificati Cash Collect.

Di conseguenza, ai sensi dell’articolo 4.5 del Prospetto di Base dei Certificati Cash Collect, la Data di Valutazione e la Data di Valutazione dell’Importo Addizionale dei Certificati sono posticipate al Giorno Lavorativo successivo nel quale non si verifichi più l’Evento di Turbativa. Se l’Evento di Turbativa continuasse per più di otto Giorni Bancari consecutivi, il nono Giorno Bancario (1 marzo 2017) sarà considerato la Data di Valutazione e Data di Valutazione dell’Importo Addizionale, anche ove in tale data si verifichi un Evento di Turbativa, e l’Emittente in buona fede e a sua discrezione determinerà il Valore di Riferimento dell’Azione affetta da un Evento di Turbativa. Il Valore di Riferimento utilizzato per la determinazione dell’Importo di Liquidazione sarà calcolato ai sensi delle condizioni di mercato prevalenti intorno alle 10.00 a.m. (ora di Milano) di tale giorno, sulla base dell’ultimo Valore di Riferimento disponibile per l’Emittente o per l’Agente per il Calcolo immediatamente antecedente al verificarsi dell’Evento di Turbativa, tenendo conto della necessità di preservare l’interesse economico dei Portatori.

In ogni caso, se entro tali otto Giorni Bancari scadono Derivati aventi caratteristiche comparabili e sono liquidati sulla Borsa di Negoziazione dei Contratti Derivati, il Prezzo di Liquidazione stabilito dalla Borsa di Negoziazione dei Contratti Derivati per i Derivati aventi caratteristiche comparabili sarà preso in considerazione nel calcolo dell’Importo di Liquidazione. In tale caso la data di scadenza dei Derivati aventi caratteristiche comparabili sarà considerata come Data di Valutazione e Data di Valutazione dell’Importo Addizionale.

La relativa data di pagamento, in entrambi i casi sopramenzionati, sarà conseguentemente posticipata.

Seguirà ulteriore comunicato dell’Emittente, che verrà pubblicato sul sito internet www.investimenti.unicredit.it

Milano, 16 Febbraio 2017

UniCredit Bank AG