

Spettabile
EuroTLX SIM S.p.A.
Via Mazzini, 11
20123 Milano

Milano, 16 febbraio 2016

OGGETTO: EVENTO RILEVANTE CON POSSIBILE SCADENZA ANTICIPATA DEI CERTIFICATI CON SOTTOSTANTE ANSALDO STS S.P.A. (IT0003977540) EMESSI DA UNICREDIT BANK AG A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

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

L'offerta pubblica di acquisto obbligatoria totalitaria sulle azioni ordinarie Ansaldo STS S.p.A. promossa da Hitachi Rail Italy Investments S.r.l. con oggetto n. 119.868.919 azioni ordinarie Ansaldo STS S.p.A. (pari al 59.93% del capitale sociale di Ansaldo STS S.p.A.).

Nel caso in cui al termine del periodo di offerta, alla chiusura delle negoziazioni del 19 febbraio 2016, l'offerente verrà a detenere una partecipazione superiore al 90%, tutti i contratti di opzione e future (i "Derivati") su azioni Ansaldo STS S.p.A. verranno chiusi e liquidati applicando la metodologia del Theoretical Fair Value (si veda avviso IDEM n. 2057 del 4 febbraio 2016).

Tali fatti, se verificati, costituiscono **Evento Rilevante** ai sensi del paragrafo 4.11 "Eventi di Turbativa di Mercato ed Eventi Rilevanti" del capitolo 4 del Prospetto di Base relativo al Programma di offerta e quotazione di Certificati Bonus depositato presso la CONSOB.

UniCredit Bank AG, Emittente dei Certificati con sottostante Ansaldo STS S.p.A. con ISIN **DE000HV4AAJ8** (i "Certificati"), in accordo con l'Agente per il Calcolo, ai sensi del paragrafo 4.11 del capitolo 4 del Prospetto di Base, informa i portatori dei **Certificati** che **potrebbero scadere anticipatamente, subordinatamente all'esito dell'offerta pubblica di acquisto totalitaria, il cui termine è previsto per il 19 febbraio 2016**. Seguirà ulteriore comunicazione in seguito alla chiusura del periodo di offerta.

UniCredit Bank AG, in qualità di Specialista dei Certificati, ha richiesto a EuroTLX la possibilità di esporre quote in solo acquisto con efficacia a partire dal 5 febbraio 2016.

In caso di scadenza anticipata dei Certificati, ai sensi del paragrafo 4.11 del capitolo 4 del Prospetto di Base, l'Agente per il Calcolo determinerà l'importo di liquidazione "Ammontare di Cessazione" dei Certificati, secondo la migliore prassi internazionale, tenendo in considerazione la modifica dei rispettivi Derivati.

Sulla base delle informazioni attualmente disponibili e fermo restando la possibilità di ulteriori aggiustamenti, la metodologia per la determinazione dell'Ammontare di Cessazione terrà in considerazione le seguenti variabili:

Data di Valutazione: chiusura del periodo di offerta (ad oggi previsto il 19 febbraio 2016)

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

Data di Pagamento: cinque giorni bancari successivi alla Data di Valutazione (indicativamente il 26 febbraio 2016)

- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** Ansaldo STS S.p.A.(ISIN IT0003977540)
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM

Cordiali saluti,

UniCredit Bank AG