

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

Milano, 30 Dicembre 2016

OGGETTO: RETTIFICA DI CERTIFICATES EMESSI DA UNICREDIT BANK AG A SEGUITO DI EVENTO DI NATURA STRAORDINARIA

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

In data 13 dicembre 2016, è stato stipulato l'atto di fusione tra Banco Popolare società cooperativa e Banca Popolare di Milano S.c.a.r.l., sulla base del progetto di fusione approvato dalle rispettive assemblee dei soci in data 15 ottobre 2016. In particolare, la fusione comporta la costituzione di una nuova società bancaria denominata Banco BPM S.p.A. e l'annullamento di tutte le azioni in circolazione di Banco Popolare e di Banca Popolare di Milano, che verranno sostituite sulla base dei seguenti rapporti di cambio:

- 1 azione Banco BPM (IT0005218380) ogni 1 azione Banco Popolare (IT0005002883)
- 1 azione Banco BPM (IT0005218380) ogni 6,386 azioni Banca Popolare di Milano (IT0000064482).

La Fusione avrà efficacia a decorrere dal 1° gennaio 2017, previo rilascio delle autorizzazioni da parte di Borsa Italiana S.p.A (si vedano gli avvisi di Borsa Italiana n. 23391 del 14.12.2016, n. 23986 del 21.12.2016 e gli avvisi IDEM n. 23406 e 23410 del 14.12.2016).

A parziale rettifica e integrazione dell'avviso n. 24234 del 23.12.2016 con oggetto "Rettifica Certificati emessi da UniCredit Bank AG su Banca Popolare di Milano" e dell'avviso del 30.12.2016 con oggetto "New Current strike level/stop loss level Notification", Unicredit Bank AG in qualità di emittente dei certificati con sottostante Banca Popolare di Milano al fine di mantenere invariata la posizione dell'investitore, in linea con le modalità di rettifica del mercato IDEM, rettifica i valori di strike e barriera dei certificati minifuture su tale sottostante, base al coefficiente di rettifica K=6,386 con efficacia a partire dal 02.01.2017 (si veda la tabella 1). Rimangono invariate le restanti caratteristiche.

- **Data di efficacia:** 2 Gennaio 2017
- **Codice ISIN del sottostante:** Banca Popolare di Milano S.c.a.r.l. (IT0000064482) è sostituito dall'azione ordinaria Banco BPM S.p.A. (IT0005218380)
- **Coefficiente di rettifica:** 6,386
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Caratteristiche dei certificates/cw ante e post rettifica in forma tabellare:**
si veda Tabella 1

Tabella 1:

ISIN	Tipologia	Precedente Sottostante	Nuovo Sottostante	Tipologia	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Barriera	Nuova Barriera
DE000HV4A710	Minifuture	Banca Pop. di Milano S.C.a.R.L (IT0000064482)	Banco BPM S.p.A. (IT0005218380)	Put	0,8309	5,3061274	0,78	4,98108
DE000HV4BLJ3	Minifuture	Banca Pop. di Milano S.C.a.R.L (IT0000064482)	Banco BPM S.p.A. (IT0005218380)	Put	0,4885	3,119561	0,468	2,988648

Data di efficacia della rettifica: 02 Gennaio 2017.

Cordiali saluti,
UniCredit Bank AG