

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

Milano, 3 giugno 2016

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

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

Banco Popolare S.p.A. ha reso noto l'aumento di capitale a pagamento. Il Consiglio di Amministrazione ha deliberato l'emissione di n. 465.581.304 nuove azioni prive di indicazione del valore nominale, aventi le medesime caratteristiche delle azioni ordinarie già in circolazione e godimento regolare, da offrire in opzione agli azionisti della Società nel rapporto di n.9 Azioni Banco Popolare ogni n. 7 azioni possedute, al prezzo di sottoscrizione di Euro 2.14 per ciascuna azione Banco Popolare I diritti di opzione potranno essere esercitati a partire dal 6 giugno 2016 (si veda l'Avviso di Borsa Italiana n.11100 del 2 giugno 2016 e n. 11201 del 3 giugno 2016, gli avvisi IDEM n. 11170 e 11171 del 2 giugno 2016 e n. 11210 del 3 giugno 2016).

Al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Certificati emessi da UniCredit Bank AG, con efficacia a partire dall'inizio delle negoziazioni del 6 giugno 2016, in linea con le modalità di rettifica del mercato dei derivati IDEM, i valori di Strike e caratteristiche degli strumenti applicabili vengono rettificati come indicato in Tabella 1, in base al coefficiente di rettifica determinato e pubblicato da IDEM al termine delle contrattazioni in data 3 giugno 2016 pari a 0.741939.

Tali rettifiche sono efficaci dal 6 giugno 2016.

- **Data di efficacia:** 6 giugno 2016
- **Coefficiente di rettifica:** 0.741939
- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** IT0005002883
- **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	Sottostante	Scadenza	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Barriera %	Precedente Barriera	Nuova Barriera	Precedente Bonus e Cap %	Precedente Cap	Nuovo Cap
DE000HV4AXC5	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/12/2016	15.42	11.4407	75	11.565	8.5805	118.5	18.2727	13.5572
DE000HV4BAY5	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/06/2017	6.355	4.715	70	4.4485	3.3005	132	8.3886	6.2238
DE000HV4AXD3	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	15/12/2017	15.42	11.4407	70	10.794	8.0085	128.5	19.8147	14.7013
DE000HV4BAZ2	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	15/12/2017	6.355	4.715	75	4.76625	3.5363	148	9.4054	6.9782
DE000HV4A959	Top Bonus	Banco Popolare S.p.A.	16/12/2016	6.355	4.715	80	5.084	3.772	120	7.626	5.658
DE000HV4A025	Top Bonus	Banco Popolare S.p.A.	18/09/2017	13.22	9.8084	85	11.237	8.3371	122	16.1284	11.9662
DE000HV4BCJ2	Cash Collect	Banco Popolare S.p.A.	17/02/2017	7.72	5.7278	75	5.79	4.2959	n.a.	n.a.	n.a.

Data di efficacia della rettifica: 6 giugno 2016

Cordiali saluti,
UniCredit Bank AG