

Spettabile
Borsa Italiana S.p.A.
Piazza Affari, 6
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
DE000HV4ANP8	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	17/06/2016	14.34	10.6394	75	10.755	7.9796	114	16.3476	12.1289
DE000HV4A587	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	21/11/2016	9.745	7.2302	80	7.796	5.7842	115	11.2068	8.3147
DE000HV4BE70	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/12/2016	6.24	4.6297	55	3.432	2.5463	115	7.176	5.3242
DE000HV4AFA6	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/12/2016	12.05	8.9404	80	9.64	7.1523	141	16.9905	12.606
DE000HV4BE88	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/12/2016	6.24	4.6297	75	4.68	3.4723	135	8.424	6.2501
DE000HV4BE96	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/06/2017	6.24	4.6297	50	3.12	2.3149	119.5	7.4568	5.5325
DE000HV4BFA4	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/06/2017	6.24	4.6297	70	4.368	3.2408	144	8.9856	6.6668
DE000HV4BFB2	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	15/12/2017	6.24	4.6297	50	3.12	2.3149	124.5	7.7688	5.764
DE000HV4BFC0	Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	15/12/2017	6.24	4.6297	70	4.368	3.2408	150	9.36	6.9446
DE000HV4ARD5	Top Bonus	Banco Popolare S.p.A.	16/12/2016	15.17	11.2552	85	12.8945	9.5669	114.5	17.3697	12.8872
DE000HV4AU55	Reverse Bonus Cap	Banco Popolare S.p.A.	16/12/2016	15.98	11.8562	125	19.975	14.8203	116	13.4232	9.9592

DE000HV4BG52	Cash Collect	Banco Popolare S.p.A.	16/06/2017	5.25	3.8952	75	3.9375	2.9214	n.a.	n.a.	n.a.
DE000HV4AP29	Cash Collect	Banco Popolare S.p.A.	15/12/2017	15.17	11.2552	75	11.3775	8.4414	n.a.	n.a.	n.a.
DE000HV4ATG4	Express	Banco Popolare S.p.A.	21/12/2018	14.35	10.6468	70	10.045	7.4528	n.a.	n.a.	n.a.

Data di efficacia della rettifica: 6 giugno 2016

Cordiali saluti,
UniCredit Bank AG