

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

Milano, 29 Aprile 2016

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

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

L'Assemblea degli azionisti Fiat Chrysler Automobiles N.V. (in breve FIAT-FCA) ha approvato una scissione, che costituisce il passaggio iniziale dell'operazione precedentemente annunciata relativa alla distribuzione ai titolari delle azioni ordinarie FIAT-FCA delle azioni ordinarie di RCS MediaGroup S.p.A. (in breve RCS) detenute da FIAT-FCA (si vedano gli avvisi di Borsa Italiana n. 7282 del 18 aprile 2016, n. 7433 del 20 aprile 2016 e avvisi IDEM n. 7458 del 20 aprile 2016 e n. 8341 del 29 aprile 2016).

In particolare, è previsto il trasferimento della partecipazione in RCS a Interim One B.V. (secondo il rapporto di n. 1 azione Interim One B.V. ogni n. 1 azione FIAT-FCA posseduta) e successiva liquidazione di Interim One B.V. con conseguente assegnazione di azioni RCS agli azionisti FIAT-FCA nel rapporto di n. 0.067746 azioni ordinarie RCS (prive di valore nominale) per ogni n. 1 azione ordinaria FIAT-FCA (del valore nominale di 0.01 Euro) posseduta.

Al fine di mantenere invariata la posizione degli investitori dei Certificati emessi da UniCredit Bank AG, **subordinatamente al perfezionamento dell'operazione** (che sarà reso noto con avviso di Borsa Italiana entro le ore 7:59 del 2 maggio 2016), con efficacia a partire dall'inizio delle negoziazioni del 2 maggio 2016, in linea con le modalità di rettifica del mercato dei derivati IDEM, i valori di Strike, il Valore Iniziale del Componente il paniere 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 29 aprile 2016.

Si precisa che:

- i Certificati con Sottostante costituito da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. sono rettificati in base al coefficiente di rettifica 0.994559
- i Certificati con Sottostante o Componente il Paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. ed 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. sono rettificati in base al coefficiente di rettifica 0.996514

Tali rettifiche sono efficaci dal 2 maggio 2016, subordinatamente al verificarsi delle condizioni sopracitate.

- **Data di efficacia:** 2 maggio 2016 (subordinatamente al perfezionamento dell'operazione)

- **Coefficiente di rettifica:**

- Per gli strumenti con Sottostante costituito da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V.: coefficiente di rettifica 0.994559
- Per gli strumenti con Sottostante o Componente il Paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. ed 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V.: coefficiente di rettifica 0.996514

- **Codice ISIN dell'azione sottostante:** Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643)
- **Mercato dei derivati di riferimento:** IDEM
- **Caratteristiche dei certificates/cw ante e post rettifica in forma tabellare:**
si veda Tabella 1

ISIN	Tipologia	Sottostante	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Barriera%	Precedente Barriera	Nuova Barriera	Precedente Bonus% e Cap%	Precedente Cap	Nuovo Cap
DE000HV4A4S5	Bonus Cap Worst of	Paniere composto da: Volkswagen Tesla Motors un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	12.6102	12.5662	60%	7.5661	7.5397	-	-	-
DE000HV4BB81	Top Bonus	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	5.435	5.4054	80%	4.348	4.3243	113.5%	6.1687	6.1351
DE000HV4A1E1	Top Bonus	un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	11.601	11.5606	85%	9.8609	9.8265	111.50%	12.9351	12.8901
DE000HV4BBA3	Bonus Cap	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	5.2300	5.2015	75%	3.9225	3.9011	138.50%	7.2436	7.2041
DE000HV4BA90	Bonus Cap	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	5.2300	5.2015	70%	3.6610	3.6411	123%	6.4329	6.3978
DE000HV4AXX1	Bonus Cap	un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	12.89	12.8451	75%	9.6675	9.6338	117%	15.0813	15.0288
DE000HV4A2H2	Bonus Cap	un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	12.1506	12.1082	75%	9.113	9.0812	127.50%	15.492	15.4380

ISIN	Tipologia	Sottostante	Precedente Strike	Nuovo Strike	Precedente Barriera%	Precedente Barriera	Nuova Barriera
DE000HV4BCN4	Cash Collect	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	5.8300	5.7983	75%	4.3725	4.3487
DE000HV4A3L2	Cash Collect Worst of	Paniere composto da: - Intesa Sanpaolo - un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	13.7793	13.7313	65%	8.9565	8.9253
DE000HV4A3M0	Cash Collect Worst of	Paniere composto da: - Telecom Italia - un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	13.7793	13.7313	65%	8.9565	8.9253
DE000HV4A4V9	Cash Collect Worst of	Paniere composto da: - Banca Popolare di Milano - Telecom Italia - un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	12.6102	12.5662	72%	9.0793	9.0477
DE000HV4A4W7	Cash Collect Worst of	Paniere composto da: - Finmeccanica - Telecom Italia - un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	12.6102	12.5662	65%	8.1966	8.1680

DE000HV4A4Y3	Cash Collect Worst of	Paniere composto da: - Arcelormittal - Société Générale - un paniere composto da un'azione ordinaria Fiat Chrysler Automobiles N.V. (NL0010877643) e 0.1 azioni ordinarie Ferrari N.V. (NL0011585146)	12.6102	12.5662	65%	8.1966	8.1680
--------------	-----------------------	---	---------	---------	-----	--------	--------

Data di efficacia della rettifica: 2 maggio 2016 (subordinatamente al perfezionamento dell'operazione)

Cordiali saluti,
UniCredit Bank AG