

Avviso agli Investitori

relativo ai Certificati Cash Collect Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. 23/10/2017 con ISIN DE000HV8BH24 (i "Certificati")

In riferimento all'avviso pubblicato sul sito dell'Emittente www.investimenti.unicredit.it in data 19.10.2017 relativo ai Certificati Cash Collect con ISIN DE000HV8BH24, ai sensi dell'articolo 4.11 "Eventi di Turbativa dei Mercato ed Eventi Rilevanti" del Prospetto di Base di Certificati Cash Collect, Unicredit Bank AG, in qualità di Emittente e Agente per il Calcolo, comunica l'Importo di Liquidazione dei Certificati, come di seguito determinato.

In seguito alla scadenza del 20 ottobre 2017 dei Derivati con sottostante l'azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. sul mercato IDEM di Borsa Italiana:

- la data di scadenza dei Derivati è considerata la Data di Valutazione dei Certificati (20 ottobre 2017)
- la Data di Pagamento dell'Importo di Liquidazione dei Certificati, indicata nelle Condizioni Definitive al quinto Giorno Lavorativo successivo alla Data di Valutazione, è il 27 ottobre 2017
- il Prezzo di Liquidazione stabilito dalla Borsa di Negoziazione dei Contratti Derivati per i Derivati aventi caratteristiche comparabili in scadenza a ottobre 2017 è pari a 15.08 Eur, ultimo prezzo di riferimento dell'azione disponibile ai sensi dell'articolo 5.1.2 del Regolamento di Borsa Italiana. Tale Prezzo di Liquidazione è considerato il Valore di Riferimento dell'azione Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A. al 20 ottobre 2017.

Essendo il Valore di Riferimento (15.08 Eur) inferiore alla Barriera (254.9925 Eur), l'Importo di Liquidazione calcolato secondo la formula all'articolo 13 delle Condizioni Definitive, arrotondato al secondo decimale ai sensi del Prospetto di Base, è pari a 4.44 Eur per Certificato, come di seguito descritto:

Importo di Liquidazione = Prezzo di Emissione x Max [Protection ; (Valore di Riferimento / Strike)] x Lotto Minimo di Negoziazione

Dove:

Prezzo di Emissione = 100 Eur, come indicato all'articolo 34 delle Condizioni Definitive

Protection = 0%, come indicato all'articolo 13 delle Condizioni Definitive

Lotto Minimo di Esercizio = 1 Certificato, come indicato all'articolo 37 delle Condizioni Definitive

Valore di Riferimento = 15.08 Eur, come sopra descritto

Strike = 339.99 Eur, come da avviso agli investitori pubblicato in data 25 novembre 2016 con oggetto "Rettifica di Certificati emessi da UniCredit Bank AG a seguito di evento di natura straordinaria" relativo al raggruppamento azionario di Banca Monte dei Paschi di Siena.

Importo di Liquidazione = $100 \times \text{Max} [0 ; (15.08 / 339.99)] \times 1 = 4.44$ Eur per Certificato

L'Importo di Liquidazione sarà accreditato ai possessori del Certificato con data di pagamento 27 ottobre 2017.

Milano, 23 ottobre 2017
UniCredit Bank AG

UniCredit Bank AG
Succursale di Milano

Piazza Gae Aulenti, 4 – Torre C
20154 Milano, Italia
Tel. +39 02 8862-1

Sede in Milano, Italia
Banca iscritta all'Albo delle Banche (codice ABI 03081.7)
Codice Fiscale, Partita IVA
e n. Iscrizione al Registro delle Imprese di Milano 09144100154

Consiglio di Gestione:
Dr. Theodor Weimer (Board Spokesman),
Peter Buschbeck, Dr. Michael Diederich,
Heinz Laber, Robert Schindler,
Andrea Varese, Guglielmo Zadra

Presidente del Consiglio di Sorveglianza:
Gianni Franco Papa

Forma legale: Aktiengesellschaft
Capitale Sociale EUR 2.407.151.016 interamente versato
Sede Legale: Monaco, Germania
N. iscrizione al Court Register di Monaco HR B 421 48
Tax-Id.No.: 143/1077/1008
VAT Reg.No.: DE 129 273 380

www.cib.unicredit.eu