

AVVISO n.21731

23 Dicembre 2011

SeDeX

Mittente del comunicato : SOCIETE GENERALE
Societa' oggetto : SOCIETE GENERALE
dell'Avviso : Societe Generale Effekten
Oggetto : Securitised Derivatives – Rettifiche

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Dal giorno 27/12/2011 il listino ufficiale verrà modificato di conseguenza.

All'attenzione di: Borsa Italiana

Da: Société Générale

Data: 23/12/2011

Oggetto: Rettifica dei prezzi di esercizio e delle parità dei Covered Warrants su UniCredit; rettifica dei valori S_0 (Closing Price of the Underlying on the Initial Valuation Date) e Barriera dei Bonus Cap Certificate su UniCredit;

A seguito delle operazioni di raggruppamento delle azioni ordinarie da realizzarsi con un rapporto di n. 1 nuova azione ordinaria (cedola n.1 e seguenti) senza valore nominale ogni n. 10 azioni ordinarie (cedola n. 33 e seguenti) senza valore nominale possedute e delle azioni di risparmio con un rapporto di n. 1 nuova azione di risparmio (cedola n.1 e seguenti) senza valore nominale ogni n. 10 azioni di risparmio (cedola n. 33 e seguenti) senza valore nominale possedute (cfr. Avviso di Borsa Italiana n. 21565 del 22 Dicembre 2011) i Covered Warrants su azioni UniCredit emessi da Société Générale subiranno, con efficacia dal 27 Dicembre 2011, le seguenti modifiche sulla base dell'applicazione del coefficiente di rettifica K pari a 10, così come pubblicato dal Mercato IDEM (cfr. Avviso di Borsa Italiana n. 21608 del 22 Dicembre 2011). Gli strike price verranno moltiplicati per il coefficiente K, mentre le parità verranno divise per tale coefficiente, come segue:

Codice Isin	Codice Negoziazione	Sottostante	Tipo	Scadenza	Vecchio Strike	Nuovo Strike	Vecchia Parità	Nuova Parità
FR0011103589	S12479	UNICREDIT	CALL	19/12/2014	1.6	16	0.1	0.01
FR0011033489	S11986	UNICREDIT	CALL	19/12/2014	2.4	24	0.1	0.01
FR0011134253	S12759	UNICREDIT	CALL	19/12/2014	2	20	0.1	0.01
FR0011033497	S11987	UNICREDIT	CALL	19/12/2014	3	30	0.1	0.01
FR0011033513	S11988	UNICREDIT	CALL	19/12/2014	4	40	0.1	0.01
FR0011033539	S11989	UNICREDIT	CALL	19/12/2014	5	50	0.1	0.01
FR0011134261	S12760	UNICREDIT	PUT	19/12/2014	0.8	8	0.1	0.01
FR0011118421	S12671	UNICREDIT	CALL	20/12/2013	1.2	12	0.1	0.01
FR0011103555	S12478	UNICREDIT	CALL	20/12/2013	1.6	16	0.1	0.01
FR0010993022	S11659	UNICREDIT	CALL	20/12/2013	2.4	24	0.1	0.01
FR0011134238	S12757	UNICREDIT	CALL	20/12/2013	2	20	0.1	0.01
FR0010942953	S11336	UNICREDIT	CALL	20/12/2013	3	30	0.1	0.01
FR0010876557	S11129	UNICREDIT	CALL	20/12/2013	4	40	0.1	0.01
FR0010876565	S11130	UNICREDIT	CALL	20/12/2013	5	50	0.1	0.01
FR0011134246	S12758	UNICREDIT	PUT	20/12/2013	0.8	8	0.1	0.01
FR0010823278	S10580	UNICREDIT	CALL	21/12/2012	2.8643	28.643	0.1047	0.0105
FR0010823286	S10581	UNICREDIT	CALL	21/12/2012	3.8191	38.191	0.1047	0.0105
FR0010823294	S10582	UNICREDIT	CALL	21/12/2012	4.7738	47.738	0.1047	0.0105
FR0010823302	S10583	UNICREDIT	PUT	21/12/2012	1.5276	15.276	0.1047	0.0105
FR0011103514	S12476	UNICREDIT	CALL	21/12/2012	1.2	12	0.1	0.01
FR0011103548	S12477	UNICREDIT	CALL	21/12/2012	1.6	16	0.1	0.01
FR0010993006	S11658	UNICREDIT	CALL	21/12/2012	2.4	24	0.1	0.01

FR0011134212	S12755	UNICREDIT	PUT	21/12/2012	0.8	8	0.1	0.01
FR0011134220	S12756	UNICREDIT	PUT	21/12/2012	1	10	0.1	0.01
FR0011103449	S12474	UNICREDIT	CALL	21/09/2012	1.2	12	0.1	0.01
FR0011103464	S12475	UNICREDIT	CALL	21/09/2012	1.6	16	0.1	0.01
FR0011033646	S11980	UNICREDIT	CALL	21/09/2012	2.2	22	0.1	0.01
FR0011033653	S11981	UNICREDIT	CALL	21/09/2012	2.4	24	0.1	0.01
FR0011033661	S11982	UNICREDIT	CALL	21/09/2012	2.6	26	0.1	0.01
FR0011033638	S11979	UNICREDIT	CALL	21/09/2012	2	20	0.1	0.01
FR0011134196	S12753	UNICREDIT	PUT	21/09/2012	0.8	8	0.1	0.01
FR0011033679	S11983	UNICREDIT	PUT	21/09/2012	1.4	14	0.1	0.01
FR0011033455	S11984	UNICREDIT	PUT	21/09/2012	1.6	16	0.1	0.01
FR0011033463	S11985	UNICREDIT	PUT	21/09/2012	1.8	18	0.1	0.01
FR0011134204	S12754	UNICREDIT	PUT	21/09/2012	1	10	0.1	0.01
FR0011103407	S12472	UNICREDIT	CALL	15/06/2012	1.2	12	0.1	0.01
FR0011103415	S12473	UNICREDIT	CALL	15/06/2012	1.6	16	0.1	0.01
FR0011118405	S12670	UNICREDIT	CALL	15/06/2012	1	10	0.1	0.01
FR0011033570	S11973	UNICREDIT	CALL	15/06/2012	2.2	22	0.1	0.01
FR0011033588	S11974	UNICREDIT	CALL	15/06/2012	2.4	24	0.1	0.01
FR0011033596	S11975	UNICREDIT	CALL	15/06/2012	2.6	26	0.1	0.01
FR0011033547	S11972	UNICREDIT	CALL	15/06/2012	2	20	0.1	0.01
FR0011134170	S12751	UNICREDIT	PUT	15/06/2012	0.8	8	0.1	0.01
FR0011033604	S11976	UNICREDIT	PUT	15/06/2012	1.4	14	0.1	0.01
FR0011033612	S11977	UNICREDIT	PUT	15/06/2012	1.6	16	0.1	0.01
FR0011033620	S11978	UNICREDIT	PUT	15/06/2012	1.8	18	0.1	0.01
FR0011134188	S12752	UNICREDIT	PUT	15/06/2012	1	10	0.1	0.01
FR0011103340	S12470	UNICREDIT	CALL	16/03/2012	1.2	12	0.1	0.01
FR0011103357	S12471	UNICREDIT	CALL	16/03/2012	1.6	16	0.1	0.01
FR0011118389	S12669	UNICREDIT	CALL	16/03/2012	1	10	0.1	0.01
FR0011033422	S11966	UNICREDIT	CALL	16/03/2012	2.2	22	0.1	0.01
FR0011033430	S11967	UNICREDIT	CALL	16/03/2012	2.4	24	0.1	0.01
FR0011033448	S11968	UNICREDIT	CALL	16/03/2012	2.6	26	0.1	0.01
FR0011033414	S11965	UNICREDIT	CALL	16/03/2012	2	20	0.1	0.01
FR0011134071	S12749	UNICREDIT	PUT	16/03/2012	0.8	8	0.1	0.01
FR0011033471	S11969	UNICREDIT	PUT	16/03/2012	1.4	14	0.1	0.01
FR0011033505	S11970	UNICREDIT	PUT	16/03/2012	1.6	16	0.1	0.01
FR0011033521	S11971	UNICREDIT	PUT	16/03/2012	1.8	18	0.1	0.01
FR0011134162	S12750	UNICREDIT	PUT	16/03/2012	1	10	0.1	0.01

Inoltre, ai sensi del Programma di Emissione “Debt Issuance Programme for the Issue of Notes and Certificates” di Société Générale Effekten GmbH datato 02 Marzo 2011 e successivi supplementi (“il Programma”), il raggruppamento di azioni di cui sopra rientra tra le fattispecie che possono causare un potenziale evento di rettifica (“Potential Adjustment Event”).

Come previsto nella Parte 2 dell'Equity Technical Annex del Programma nel caso di un raggruppamento di azioni, Société Générale SA in qualità di Agente di Calcolo ("Calculation Agent") applicherà, con efficacia dal 27 Dicembre 2011, ai Bonus Cap Certificate con sottostante UniCredit, le rettifiche del relativo Strike S_0 e della Barriera. Conseguentemente, i relativi valori S_0 di UniCredit (Closing Price of the Underlying on the Initial Valuation Date) e della Barriera (saranno moltiplicati per un coefficiente di rettifica K pari a 10 così come determinato da Borsa Italiana, cfr Avviso di Borsa Italiana n. 21608 del 22 Dicembre 2011). Si ricorda che verranno altresì rettificati i valori Bonus e Cap espressi in % rispetto al Nuovo S_0 .

Nella tabella di seguito i valori rettificati:

Codice Isin	Codice Negoziazione	Sottostanti	Tipo	Scadenza	Vecchio S_0	Nuovo S_0	Vecchio Barrier Level	Nuovo Barrier Level	Bonus /Cap%
IT0006721077	S12678	UNICREDIT	Bonus Cap Certificate	22/06/2012	0.8255	8.255	0.4953	4.953	129%
IT0006721085	S12679	UNICREDIT	Bonus Cap Certificate	28/12/2012	0.8255	8.255	0.4127	4.127	134%

Le rettifiche avranno efficacia a far data dal 27/12/2011.

Distinti saluti
Société Générale