



Borsa Italiana

AVVISO n.7459	20 Aprile 2016	Idem
--------------------------	----------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto dell'Avviso : FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES

Oggetto : IDEM - FREE ATTRIBUTION OF RCS
MEDIAGROUP SHARES TO FIAT
CHRYSLER AUTOMOBILIES
SHAREHOLDERS: IMPACT ON STOCK
FUTURES CONTRACTS ON FCA
SHARES

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

IDEM

ASSEGNAZIONE DI AZIONI RCS MEDIAGROUP AGLI AZIONISTI DI FIAT CHRYSLER AUTOMOBILIES: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI FIAT CHRYSLER AUTOMOBILIES

Le seguenti disposizioni sono subordinate al perfezionamento dell'operazione (si veda avviso n. 7282 del 18 aprile 2016).

CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA	Contratti futures su azioni FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES (di seguito "FCA").
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Assegnazione di n. 0,067746 azioni ordinarie RCS per ogni n. 1 azione ordinaria FCA posseduta (si veda Avviso di Borsa n. 7282 del 18 aprile 2016)
DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 29 aprile 2016.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi dell'articolo IA.9.1.12 delle "Istruzioni al Regolamento dei mercati organizzati e gestiti da Borsa Italiana S.p.A.", l'intervento di rettifica incide sul prezzo di chiusura giornaliero e sul numero di titoli (lotto) oggetto dei contratti futures.
MODALITÀ DI RETTIFICA	L'intervento di rettifica avviene mediante l'applicazione del coefficiente K, calcolato secondo la formula riportata nell'Avviso di Borsa Italiana n. 7433 del 20 aprile 2016 e arrotondato alla sesta cifra decimale.
RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ dove:

	<p>E_{cum} = prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica</p> <p>E_{ex} = prezzo di chiusura giornaliero dopo la rettifica</p> <p>Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.</p>
RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEL CONTRATTO FUTURES	<p>A_{ex} = lotto / K</p> <p>dove:</p> <p>A_{ex} = il numero di azioni (lotto) FCA dopo la rettifica arrotondato all'intero.</p>
RETTIFICA DEI FUTURES SU BASKET DI AZIONI FCA E RACE	<p>Ai fini delle rettifiche dei futures su basket di azioni FCA e RACE verrà calcolato un fattore di rettifica ad hoc utilizzando quale prezzo cum il valore del basket di azioni FCA e RACE nel giorno di Borsa antecedente l'avvio dell'operazione (29 aprile 2016)</p>
CONTRATTI RETTIFICATI	<p>Tutti i contratti futures su azioni FCA in negoziazione al termine della seduta del 29 aprile 2016.</p>
CODICE ISIN	<p>Le serie rettificate saranno generate con un nuovo codice ISIN e presenteranno una "X" al termine dell'identificativo della serie, ovvero una "Y" per le serie con sottostante il basket FCA e RACE.</p>

I contratti rettificati saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla serata del 29 aprile 2016: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali long order presenti sui book dei contratti futures su azioni FCA al termine della seduta di negoziazione del 29 aprile 2016 saranno cancellati.

Per qualunque tipo d'informazione sugli interventi di rettifica sui contratti futures su azioni, è possibile contattare il mercato IDEM al seguente indirizzo: IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it



IDEM

FREE ATTRIBUTION OF RCS MEDIAGROUP SHARES TO FIAT CHRYSLER AUTOMOBILIES SHAREHOLDERS: IMPACT ON STOCK FUTURES CONTRACTS ON FIAT CHRYSLER AUTOMOBILIES SHARES

The below provisions are subjected to the completion of the transaction (see Avviso di Borsa Italiana n. 7282 dated 18 April 2015).

CONTRACTS TO BE ADJUSTED	Stock futures contracts on FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES ("FCA") shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Attribution of n. 0.067746 RCS ordinary shares for every n. 1 FCA ordinary share held (please see Borsa Italiana notice n. 7282 dated 18 April 2016)
DATE OF THE ADJUSTMENT	At the close of the trading session on 29 April 2016.
ADJUSTEMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, article IA.9.1.12, Borsa Italiana notifies that daily closing prices and the number of shares (lot) underlying the stock futures contracts shall be adjusted.
ADJUSTMENT CONDITIONS	The adjustment intervention shall be done by applying the coefficient K according to the formula included in the Borsa Italiana notice n. 7433 dated 20 April 2016 and rounded to sixth decimal digit.
ADJUSTMENT OF THE DAILY CLOSING PRICES	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>where:</p> $E_{cum} = \text{daily closing price before the adjustment}$



	<p>E_{ex} = daily closing price after the adjustment</p> <p>Daily closing price shall be rounded to four decimal places.</p>
ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING THE STOCK FUTURES CONTRACTS	<p>A_{ex} = lot size / K</p> <p>where: A_{ex} = number of FCA shares (lot) after the adjustment</p>
ADJUSTMENT ON FUTURES CONTRACTS ON BASKET OF FCA AND RACE SHARES	<p>The K coefficient regarding the adjustment on futures contracts on basket of FCA and RACE shares will be computed based on the last price of the basket as of 29 April 2016</p>
ADJUSTED CONTRACTS	<p>All stock futures contracts on FCA shares at the close of trading session on 29 April 2016.</p>
ISIN CODE	<p>The adjusted stock futures series will be generated with a new ISIN code and will have an "X" at the end of the stock futures series identification code or a "Y" for series with the basket FCA and RACE.</p>

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the close of the trading day on 29 April 2016: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures contracts on FCA shares active at the end of the trading session on 29 April 2016 will be deleted.

For further information regarding the adjustment intervention on stock futures contracts, please contact the IDEM market at the following email address: IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it

