

AVVISO n.14764

23 Settembre 2009

Idem

Mittente del comunicato : Borsa Italiana
Societa' oggetto dell'Avviso : MEDIOBANCA
Oggetto : IDEM – FREE SHARE CAPITAL INCREASE:
IMPACT ON STOCK FUTURES ON
MEDIOBANCA SHARES

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

AUMENTO GRATUITO DEL CAPITALE SOCIALE: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI MEDIOBANCA

I seguenti interventi di rettifica avranno luogo subordinatamente all'espletamento di tutti gli adempimenti necessari da parte della società.

CONTRATTO OGGETTO DI RETTIFICA	Contratti futures su azioni Mediobanca.
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Aumento del capitale sociale mediante assegnazione gratuita ai soci di 1 nuova azione Mediobanca ogni 20 azioni possedute e di 1 warrant Mediobanca per ogni azione posseduta (cfr. Avviso di Borsa Italiana n. 14666 del 21 settembre 2009).
DATA DI INTERVENTO DELLA RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 25 settembre 2009.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi degli art. IA.9.1.11 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. 14762 del 23 settembre 2009 e arrotondato alla sesta cifra decimale.
RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>dove:</p> $E_{cum} = \text{prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica}$ $E_{ex} = \text{prezzo di chiusura giornaliero dopo la rettifica}$ <p>Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.</p>

RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEL CONTRATTO FUTURES	$A_{ex} = 500 \times \frac{1}{K}$ <p>dove: $A_{ex} = \text{numero di azioni (lotto) dopo la rettifica}$</p>
CONTRATTI RETTIFICATI	Applicazione a tutti i contratti futures su azioni in negoziazione al termine della seduta del 25 settembre 2009.
CODICE ISIN	I contratti rettificati verranno generati con un nuovo codice ISIN e presenteranno una "X" al termine della serie identificativa.

Le serie rettificate saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla serata del 25 settembre 2009:

<http://www.borsaitalia.it/quotazioni/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni Mediobanca al termine della seduta di negoziazione del 25 settembre 2009 saranno cancellati.

Per qualunque tipo di informazione relativa agli interventi di rettifica sui contratti futures su azioni, è possibile contattare direttamente la Divisione Derivati di Borsa Italiana S.p.A. tramite:

- ✓ Tel. : +39 02 72426 231
- ✓ Email: IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it

FREE SHARE CAPITAL INCREASE: IMPACT ON STOCK FUTURES ON MEDIOBANCA SHARES

The following adjustment interventions shall be done subject to all the necessary formalities being completed by the company.

CONTRACT OBJECT TO ADJUSTMENT	Stock futures contracts on Mediobanca shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Free share capital increase carried out through the issue of 1 new Mediobanca share for every 20 shares held and 1 Mediobanca warrant for every 1 share held (see Avviso di Borsa Italiana n. 14666 dated September 21 st , 2009).
ADJUSTMENT INTERVENTION DATE	At the close of the trading day on September 25 th , 2009.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, Article IA.9.1.11, 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 Avviso di Borsa Italiana n. 14762 dated September 23 rd , 2009 and rounded to sixth decimal digit.
ADJUSTMENT OF THE DAILY CLOSING PRICES	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>where:</p> <p>E_{cum} = daily closing price before the adjustment</p> <p>E_{ex} = daily closing price after the adjustment</p> <p>Daily closing price shall be rounded to fourth decimal digit.</p>

<p>ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING THE STOCK FUTURES CONTRACT</p>	$A_{ex} = 500 \times \frac{1}{K}$ <p>where: A_{ex} = number of underlying shares (lot) after the adjustment</p>
<p>ADJUSTED CONTRACTS</p>	<p>The described intervention shall be applied to all stock futures contracts open for trade at the close of the trading day on September 25th, 2009.</p>
<p>ISIN CODE</p>	<p>The adjusted stock futures contracts shall be generated with a new ISIN code and have an “X” at the end of this.</p>

The adjusted series will be available on our web site at the following URL at the close of the trading day on September 25th, 2009:

<http://www.borsaitalia.it/quotazioni/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures contracts on Mediobanca shares active at the end of the trading session of September 25th, 2009 will be deleted.

For further information regarding the adjustment intervention on stock futures contracts, please contact the IDEM Market of Borsa Italiana S.p.A. at:

- ✓ Tel. : +39 02 72426 231
- ✓ Email: IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it