



Borsa Italiana

AVVISO n.2002	02 Febbraio 2017	Idem
--------------------------	------------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto
dell'Avviso : UNICREDIT

Oggetto : IDEM - CAPITAL INCREASE ON
UNICREDIT ORDINARY SHARES:
IMPACT ON STOCK FUTURES AND
DIVIDEND FUTURES CONTRACTS

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

IDEM

AUMENTO A PAGAMENTO DEL CAPITALE SOCIALE SU UNICREDIT: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI E FUTURES SU DIVIDENDI

CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA	Contratti futures su azioni e futures su dividendi UniCredit.
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Aumento a pagamento del capitale sociale, come descritto nell'Avviso di Borsa Italiana n. 2001 del 2 febbraio 2017.
DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 3 febbraio 2017.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi degli artt. IA.9.1.13 commi 1 e 3 e IA.9.1.4 comma 6 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.
DESCRIZIONE DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	L'intervento di rettifica avviene mediante l'applicazione del coefficiente K, calcolato secondo la seguente formula e arrotondato alla sesta cifra decimale: $K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}}$ dove: P _{ex} = prezzo "ex diritto" P _{cum} = prezzo "cum diritto"
RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ dove: <i>E_{cum}</i> = prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica <i>E_{ex}</i> = prezzo di chiusura giornaliero dopola rettifica Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.

RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEI CONTRATTI FUTURES E DIVIDEND FUTURES	$A_{ex} = 100 \times \frac{1}{K}$ <p>dove:</p> $A_{ex} = \text{numero di azioni (lotto) dopola rettifica}$
SERIE RETTIFICATE	Tutte le serie di contratti futures su azioni e futures su dividendi UniCredit in negoziazione al termine della seduta del 3 febbraio 2017.
CODICE ISIN	Le serie rettificate saranno generate con un nuovo codice ISIN e presenteranno una "X" al termine della serie identificativa, ovvero una "Y" se precedentemente rettificate e con una "X" finale alla chiusura delle negoziazioni del 3 febbraio 2017.

Le serie rettificate saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla serata del 3 febbraio 2017: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni e dei contratti futures su dividendi UniCredit al termine della seduta di negoziazione del 3 febbraio 2017 saranno cancellati.

Per ulteriori informazione sugli interventi di rettifica è possibile contattare il mercato IDEM al seguente indirizzo: IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it



IDEM

CAPITAL INCREASE ON UNICREDIT ORDINARY SHARES: IMPACT ON STOCK FUTURES AND DIVIDEND FUTURES CONTRACTS

CONTRACTS TO BE ADJUSTED	Stock futures and dividend futures contracts on Unicredit.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Capital increase, as described in Borsa Italiana Announcement nr. 2001 dated 2 February 2017.
DATE OF THE ADJUSTMENT	At the close of the trading session on 3 February 2017.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, Articles IA.9.1.13 paragraphs 1 and 3 and IA.9.1.4 paragraph 6, the daily closing prices and the number of shares (lot) underlying the stock futures and dividend futures contracts shall be adjusted.
DESCRIPTION OF THE ADJUSTMENT	<p>The adjustment intervention shall be done by applying the coefficient K according to the following formula and rounded to six decimal digits:</p> $K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}}$ <p>where: P_{ex} = price "ex rights" P_{cum} = price "cum rights"</p>
ADJUSTMENT OF THE DAILY CLOSING PRICES	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>where: E_{cum} = <i>daily closing price before the adjustment</i> E_{ex} = <i>daily closing price after the adjustment</i></p> <p>Daily closing price shall be rounded to four decimal digits.</p>

ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING STOCK FUTURES AND DIVIDEND FUTURES CONTRACT	$A_{ex} = 100 \times \frac{1}{K}$ <p>where:</p> <p><i>A_{ex} = number of underlying shares (lot) after the adjustment</i></p>
ADJUSTED SERIES	All stock futures and dividend futures series on UniCredit open for trade at the close of trading session on 3 February 2017.
ISIN CODE	The adjusted stock futures and dividend futures series shall be generated with a new ISIN code and have an "X" at the end, or a "Y" if previously adjusted and with a final "X" at the close of the trading session on 3 February 2017.

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the close of the trading day on 3 February 2017: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures and dividend futures contracts on UniCredit active at the end of the trading session of 3 February 2017 will be deleted.

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

