

AVVISO n.12555

03 Agosto 2009

Idem

Mittente del comunicato : Borsa Italiana
Societa' oggetto dell'Avviso : PARMALAT
Oggetto : IDEM – PAGAMENTO DI DIVIDENDO STRAORDINARIO:
IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURE SU AZIONI PARMALAT

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

PAGAMENTO DI DIVIDENDO STRAORDINARIO: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURE SU AZIONI PARMALAT

CONTRATTO OGGETTO DI RETTIFICA	Contratti <i>future</i> su azioni PARMALAT.
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Distribuzione di un acconto di dividendo pari a 0,041 Euro per azione (cfr. Avviso di Borsa Italiana n. 12304 del 30 luglio 2009).
DATA DI INTERVENTO DELLA RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 18 settembre 2009.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi dell'art. IA.9.1.11 comma 2, lettera a) 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 future per tutte le scadenze sino a marzo 2010 incluso.
MODALITÀ DI RETTIFICA	L'intervento di rettifica avviene mediante l'applicazione del coefficiente K, calcolato secondo la seguente formula e arrotondato alla sesta cifra decimale. $K = \frac{P_{uff} - \text{Importo del dividendo straordinario}}{P_{uff}}$ dove: <i>Importo del dividendo straordinario</i> = 0,041 Euro
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 dopo la rettifica Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.

RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEL CONTRATTO FUTURE	$A_{ex} = 1000 \times \frac{1}{K}$ <p>dove: $A_{ex} = \text{numero di azioni (lotto) dopo la rettifica}$</p>
CONTRATTI RETTIFICATI	Applicazione a tutti i contratti future su azioni PARMALAT con scadenze sino a marzo 2010 incluso in negoziazione al termine della seduta del 18 settembre 2009.
CODICE ISIN	I contratti rettificati verranno generati con un nuovo codice ISIN e presenteranno una "X" al termine della serie identificativa.

I contratti rettificati saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla serata del 18 settembre 2009:

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

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti future su azioni PARMALAT al termine della seduta di negoziazione del 18 settembre 2009 saranno cancellati.

Per qualunque tipo di informazione relativa agli interventi di rettifica dei contratti di future su singole 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

EXTRAORDINARY DIVIDEND PAYMENT: IMPACT ON STOCK FUTURE CONTRACTS ON PARMALAT SHARES

CONTRACT OBJECT TO ADJUSTMENT	Stock future contracts on PARMALAT shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Payment of an interim dividend equal to 0.041 Euro per share (see Avviso di Borsa Italiana n. 12304 dated July 30 th , 2009).
ADJUSTMENT INTERVENTION DATE	At the close of the trading day on September 18 th , 2009.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, Article IA.9.1.11 paragraph 2, subparagraph a), Borsa Italiana notifies that the daily closing prices and the number of shares (lot) underlying the stock future contracts shall be adjusted for all expiries until March 2010.
ADJUSTMENT CONDITIONS	<p>The adjustment intervention shall be done by applying the coefficient K according to the following formula and rounded to sixth decimal digit.</p> $K = \frac{P_{off} - \text{Extraordinary dividend amount}}{P_{off}}$ <p>where: <i>Extraordinary dividend amount</i> = 0.041 Euro</p>
ADJUSTMENT OF THE DAILY CLOSING PRICES	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>where: <i>E_{cum}</i> = daily closing price before the adjustment <i>E_{ex}</i> = 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 FUTURE CONTRACT</p>	$A_{ex} = 1000 \times \frac{1}{K}$ <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 future contracts on PARMALAT shares with expiries until March 2010 at the close of the trading day on September 18th, 2009.</p>
<p>ISIN CODE</p>	<p>The adjusted stock future contracts shall be generated with a new ISIN code and have an “X” at the end of this.</p>

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the close of the trading day on September 18th, 2009:

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

The long orders on future contracts on PARMALAT shares active at the end of the trading session of September 18th, 2009 will be deleted.

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

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