

<b>AVVISO n.40708</b>	06 Dicembre 2021	Idem
---------------------------	------------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto  
dell'Avviso : DAIMLER

Oggetto : IDEM - ASSEGNAZIONE DI AZIONI  
ORDINARIE DAIMLER TRUCK HOLDING  
: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES  
SU DIVIDENDI SU AZIONI DAIMLER

*Testo del comunicato*

Si veda allegato.

*Disposizioni della Borsa*

**IDEM – ASSEGNAZIONE DI AZIONI ORDINARIE DAIMLER TRUCK HOLDING : IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU DIVIDENDI SU AZIONI DAIMLER**

<b>CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA</b>	Contratti futures su dividendi su azioni ordinarie DAIMLER.
<b>TERMINI DELL'OPERAZIONE</b>	Assegnazione di azioni ordinarie DAIMLER TRUCK HOLDING (si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 40602 del 6 dicembre 2021).
<b>DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA</b>	Chiusura delle negoziazioni del 9 dicembre 2021.
<b>INTERVENTI DI RETTIFICA</b>	Ai sensi dell'articolo IA.8.1.6 comma 6 delle "Istruzioni al Regolamento dei mercati organizzati e gestiti da Borsa Italiana S.p.A.", l'intervento di rettifica prevede la sostituzione dei dividendi delle azioni DAIMLER oggetto dei contratti futures su dividendi con un paniere composto da dividendi di azioni ordinarie DAIMLER TRUCK HOLDING e DAIMLER .
<b>RETTIFICA DEI PREZZI DI ESERCIZIO</b>	Nessuna
<b>RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEI CONTRATTI FUTURES SU DIVIDENDI</b>	<p>Per i contratti futures su dividendi con lotto pari a 10000 azioni:</p> <p><math>A_{basket}</math>: 10000 azioni DAIMLER ex-assegnazione + 5000 azioni DAIMLER TRUCK HOLDING</p> <p>Per i contratti futures su dividendi con lotto pari a 1000 azioni:</p> <p><math>A_{basket}</math>: 1000 azioni DAIMLER ex-assegnazione + 500 azioni DAIMLER TRUCK HOLDING</p> <p>dove <math>A_{basket}</math> = numero di azioni dopo la rettifica</p>
<b>SERIE RETTIFICATE</b>	Tutte le serie di futures su dividendi di azioni DAIMLER in negoziazione al termine della seduta del 9 dicembre 2021.

	0A partire dal 10 dicembre 2021, le serie di nuova generazione avranno un lotto minimo pari a 10000 azioni DAIMLER.
<b>CODICE ISIN</b>	Le serie rettificate saranno generate con un nuovo codice ISIN e presenteranno una "X", ovvero "Y" per le serie precedentemente rettificate al termine della serie identificativa.

La dimensione minima per le operazioni concordate, la dimensione minima per quelle "outside BBO" e la dimensione minima per il differimento dell'informativa post-trade rimangono invariate.

Le serie rettificate saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla mattina del 10 dicembre 2021:  
<http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

I market maker sui contratti futures su dividendi DAIMLER quoteranno anche i contratti futures su dividendi con basket DAIMLER TRUCK HOLDING e DAIMLER

Gli eventuali long order presenti sui book dei contratti futures su dividendi su azioni DAIMLER al termine della seduta di negoziazione del 9 dicembre 2021 saranno cancellati.

**IDEM – ATTRIBUTION OF DAIMLER TRUCK HOLDING ORDINARY SHARES: IMPACT ON SINGLE STOCK DIVIDEND FUTURES CONTRACTS**

<b>CONTRACTS TO BE ADJUSTED</b>	Single stock dividend futures contracts on DAIMLER ordinary shares.
<b>DETAILS OF THE CORPORATE ACTION</b>	Attribution of DAIMLER TRUCK HOLDING ordinary shares (please refer to Borsa Italiana’s Announcement nr. 40602 dated 6 December 2021).
<b>DATE OF THE ADJUSTEMENT</b>	At the close of the trading session on 9 December 2021.
<b>ADJUSTMENT INTERVENTION</b>	According to Borsa Italiana’s Instructions, article IA.8.1.6 par. 6, the number of shares (lot) underlying the single stock dividend futures contracts on DAIMLER shares will be substituted with a basket which includes DAIMLER TRUCK HOLDING ordinary shares and DAIMLER ordinary shares
<b>ADJUSTMENT OF THE STRIKE PRICES</b>	No adjustment
<b>ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING THE SINGLE STOCK DIVIDEND FUTURES CONTRACTS</b>	<p>For single stock dividend futures with lot size equal to 10000 shares:</p> <p><math>A_{\text{basket}}</math>: 10000 DAIMLER shares ex-attribution + 5000 DAIMLER TRUCK HOLDING shares</p> <p>For single stock dividend futures with lot size equal to 1000 shares:</p> <p><math>A_{\text{basket}}</math>: 1000 DAIMLER shares ex-attribution + 500 DAIMLER TRUCK HOLDING shares</p> <p>Where <math>A_{\text{basket}}</math> = number of shares after the adjustment</p>
<b>ADJUSTED SERIES</b>	<p>All single stock dividend futures series on DAIMLER shares open for trade at the close of the trading session on 9 December 2021.</p> <p>Starting from 10 December 2021, the lot size of the new series will be equal to 10000 DAIMLER.</p>

<b>ISIN CODE</b>	The adjusted stock option series shall be generated with a new ISIN code and have a final "X", or "Y" for those series previously adjusted.
------------------	---

The minimum size for negotiated transactions, the minimum size for negotiated transactions "outside BBO" and the minimum size for post-trade deferrals are unchanged.

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the opening of the trading day on 10 December 2021:  
<http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

Market makers on single stock dividend futures on DAIMLER shares will quote the basket on DAIMLER TRUCK HOLDING and DAIMLER too.

The long orders on single stock dividend futures contracts on DAIMLER shares active at the end of the trading session of 9 December 2021 will be deleted.