

AVVISO n.40582	06 Dicembre 2021	Idem
---------------------------	------------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto dell'Avviso : MFE-MEDIAFOREUROPE

Oggetto : IDEM - ASSEGNAZIONE DI AZIONI ORDINARIE MFE A: IMPATTO SUI CONTRATTI DI OPZIONE SU AZIONI MFE B

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

IDEM – ASSEGNAZIONE DI AZIONI ORDINARIE MFE A: IMPATTO SUI CONTRATTI DI OPZIONE SU AZIONI MFE B

CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA	Contratti di opzione su azioni ordinarie MFE B
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Assegnazione di azioni ordinarie MFE A (si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 40516 del 3 dicembre 2021).
DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 10 dicembre 2021.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi dell'articolo IA.8.1.11 delle "Istruzioni al Regolamento dei mercati organizzati e gestiti da Borsa Italiana S.p.A.", l'intervento di rettifica prevede la sostituzione delle azioni MFE B oggetto dei contratti di opzione con un paniere composto da azioni ordinarie MFE A e MFE B.
RETTIFICA DEI PREZZI DI ESERCIZIO	Nessuna
RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEI CONTRATTI DI OPZIONE	<p>Per i contratti con lotto pari a 1000 azioni: A_{basket}: 1000 azioni MFE B ex-assegnazione + 1000 azioni MFE A</p> <p>Per i contratti con lotto pari a 1106 azioni: A_{basket}: 1106 azioni MFE B ex-assegnazione + 1106 azioni MFE A</p> <p>dove A_{basket} = numero di azioni dopo la rettifica</p>
SERIE RETTIFICATE	<p>Tutte le serie di opzioni su azioni MFE B in negoziazione al termine della seduta del 10 dicembre 2021.</p> <p>A partire dal 13 dicembre 2021, le serie di nuova generazione avranno un lotto minimo pari a 1000 azioni MFE B.</p>

CODICE ISIN	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.
SOSPENSIONE ESERCIZIO ANTICIPATO DEI CONTRATTI DI OPZIONE	10 dicembre 2021.

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 13 dicembre 2021:
<http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

I market maker sui contratti di opzione MFE B quoteranno anche i contratti di opzione con basket MFE A e MFE B

Gli eventuali long order presenti sui book dei contratti di opzione su azioni MFE B al termine della seduta di negoziazione del 10 dicembre 2021 saranno cancellati.

IDEM – ATTRIBUTION OF MFE A ORDINARY SHARES: IMPACT ON STOCK OPTION CONTRACTS

CONTRACTS TO BE ADJUSTED	Stock option contracts on MFE B ordinary shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Attribution of MFE A ordinary shares (please refer to Borsa Italiana's Announcement nr. 40516 dated 3 December 2021).
DATE OF THE ADJUSTEMENT	At the close of the trading session on 10 December 2021.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, article IA.8.1.11, the number of shares (lot) underlying the stock option contracts on MFE B shares will be substituted with a basket which includes MFE A ordinary shares and MFE B ordinary shares
ADJUSTMENT OF THE STRIKE PRICES	No adjustment
ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING THE STOCK OPTION CONTRACTS	<p>For stock options with lot size equal to 1000 shares: $A_{\text{basket}} = 1000 \text{ MFE B shares ex-attribution} + 1000 \text{ MFE A shares}$</p> <p>For stock options with lot size equal to 1106 shares: $A_{\text{basket}} = 1106 \text{ MFE B shares ex-attribution} + 1106 \text{ MFE A shares}$</p> <p>Where A_{basket} = number of shares after the adjustment</p>
ADJUSTED SERIES	<p>All stock option series on MFE B shares open for trade at the close of the trading session on 10 December 2021.</p> <p>Starting from 13 December 2021, the lot size of the new series will be equal to 1000 MFE B.</p>
ISIN CODE	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.

SUSPENSION OF EARLY EXERCISE OF STOCK OPTION CONTRACTS	10 December 2021.
---	-------------------

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 13 December 2021:
<http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

Market makers on stock options on MFE B shares will quote the basket on MFE A and MFE B too.

The long orders on stock option contracts on MFE B shares active at the end of the trading session of 10 December 2021 will be deleted.