



Borsa Italiana

AVVISO n.11171	02 Giugno 2016	Idem
---------------------------	----------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA
Societa' oggetto : BANCO POPOLARE
dell'Avviso
Oggetto : IDEM - CAPITAL INCREASE ON BANCO
POPOLARE ORDINARY SHARES:
IMPACT ON STOCK FUTURES
CONTRACTS

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

IDEM

AUMENTO A PAGAMENTO DEL CAPITALE SOCIALE SU BANCO POPOLARE: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES

CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA	Contratti futures su azioni ordinarie Banco Popolare.
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Aumento a pagamento del capitale sociale come descritto nell'Avviso di Borsa Italiana n. 11100 del 2 giugno 2016.
DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 3 giugno 2016.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi degli art. IA.9.1.12 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: E_{cum} = prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica E_{ex} = 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 FUTURES	$A_{ex} = 100 \times \frac{1}{K}$ <p>dove:</p> $A_{ex} = \text{numero di azioni (lotto) dopo la rettifica}$
SERIE RETTIFICATE	Tutte le serie di contratti futures su azioni ordinarie Banco Popolare in negoziazione al termine della seduta del 3 giugno 2016.
CODICE ISIN	Le serie rettificate saranno generate 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 3 giugno 2016: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni ordinarie Banco Popolare al termine della seduta di negoziazione del 3 giugno 2016 saranno cancellati.

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

IDEM

CAPITAL INCREASE ON BANCO POPOLARE ORDINARY SHARES: IMPACT ON STOCK FUTURES CONTRACTS

CONTRACTS TO BE ADJUSTED	Stock futures contracts on Banco Popolare ordinary shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Capital increase as described in Borsa Italiana Announcement nr. 11100 dated 2 June 2016.
DATE OF THE ADJUSTMENT	At the close of the trading session on 3 June 2016.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, Articles IA.9.1.12, the daily closing prices and the number of shares (lot) underlying the stock 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} = daily closing price before the adjustment E_{ex} = daily closing price after the adjustment</p> <p>Daily closing price shall be rounded to four decimal digits.</p>

ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING THE STOCK 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 series on Banco Popolare ordinary shares open for trade at the close of trading session on 3 June 2016.
ISIN CODE	The adjusted stock futures series shall be generated with a new ISIN code and have an "X" at the end.

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the close of the trading day on 3 June 2016: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures contracts on Banco Popolare ordinary shares active at the end of the trading session of 3 June 2016 will be deleted.

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