

AVVISO n.39373	13 Ottobre 2022	Idem
---------------------------	-----------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto dell'Avviso : BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA

Oggetto : IDEM – RIGHTS ISSUE: IMPACT ON STOCK OPTIONS AND STOCK FUTURES ON BANCA MONTE PASCHI SIENA SHARES

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa



IDEM – OPERAZIONI STRAORDINARIE SUL CAPITALE

Società:	Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.
Contratti:	Contratti di opzione su azioni ordinarie BANCA MONTE PASCHI SIENA Contratti futures su azioni ordinarie BANCA MONTE PASCHI SIENA
Corporate action:	Aumento di capitale
Riferimenti:	Avviso di Borsa Italiana n. 39342 del 13 ottobre 2022
Dettagli:	Aumento a pagamento del capitale sociale che prevede l'offerta in opzione agli aventi diritto di n. 374 nuove azioni ordinarie ogni n. 3 azioni ordinarie possedute al prezzo di sottoscrizione di € 2,00 cadauna.
Data di efficacia:	17 ottobre 2022
Rettifiche:	Determinazione del coefficiente K L'intervento di rettifica avviene mediante l'applicazione del coefficiente K, calcolato secondo la seguente formula: <ul style="list-style-type: none">▪ $K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}}$ dove:<ul style="list-style-type: none">▪ P_{ex} = prezzo "ex diritto"▪ P_{cum} = prezzo "cum diritto"▪ Arrotondamento: Il coefficiente di rettifica K viene arrotondato alla sesta cifra decimale.▪ Lotto: $A_{ex} = A \times \frac{1}{K}$ dove:<ul style="list-style-type: none">▪ $A = 1$▪ A_{ex} = numero di azioni sottostanti dopo la rettifica Contratti di opzione: <ul style="list-style-type: none">▪ Prezzi di esercizio: $E_{ex} = E_{cum} \times K$ dove:<ul style="list-style-type: none">▪ E_{cum} = prezzo di esercizio prima della rettifica▪ E_{ex} = prezzo di esercizio dopo la rettifica▪ Arrotondamento: Il prezzo di esercizio viene arrotondato alla quarta cifra decimale.

Contratti futures:

- **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
- **Arrotondamento:** Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.

Serie rettificate: Tutte le serie di opzioni e futures su azioni BANCA MONTE PASCHI SIENA in negoziazione al termine della seduta del 14 ottobre 2022.

Codice Isin:

- Le serie rettificate saranno generate con nuovi codici ISIN e presenteranno una "X" al termine della serie identificativa;
- Le serie che già presentano una "X" finale saranno generate con un nuovo codice ISIN e una "Y".

Esercizio anticipato: L'esercizio anticipato sarà sospeso nella seduta del 14 ottobre 2022.

Ordini: Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti di opzioni e futures su azioni BANCA MONTE PASCHI SIENA al termine della seduta di negoziazione del 14 ottobre 2022 saranno cancellati.

Pubblicità serie rettificate: Le serie rettificate saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla mattina di ciascuna delle due date di efficacia:

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

IDEM – CORPORATE ACTIONS

Company: Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.

Contracts:

Stock option contracts on BANCA MONTE PASCHI SIENA ordinary shares.

Stock futures contracts on BANCA MONTE PASCHI SIENA ordinary shares.

Corporate action: Rights issue

Reference: Borsa Italiana Announcement nr. 39342 dated 13 October 2022

Details: Share capital increase carried out through shares offered in the ratio of nr. 374 new ordinary shares for every nr. 3 ordinary shares held. The new shares will be issued at the subscription price of € 2.00 each.

Effective date: 17 October 2022

Adjustments:

Calculation of the K coefficient

The adjustment intervention shall be done by applying the coefficient K according to the following formula:

$$K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}}$$

where:

- P_{ex} = price "ex rights"
- P_{cum} = price "cum rights"

▪ **Rounding:** The K coefficient shall be rounded to six decimals.

▪ **Lot:** $A_{ex} = A \times \frac{1}{K}$

where:

- $A = 1$
- A_{ex} = number of the underlying shares after the adjustment

Option contracts:

▪ **Strike prices:** $E_{ex} = E_{cum} \times K$

where:

- E_{cum} = strike price before the adjustment
- E_{ex} = strike price after the adjustment

▪ **Rounding:** The adjusted strike price shall be rounded to four decimals.

Futures contracts:

- **Daily closing prices:** $E_{ex} = E_{cum} \times K$

where:

- E_{cum} = daily closing price before the adjustment
- E_{ex} = daily closing price after the adjustment
- **Rounding:** The adjusted daily closing price shall be rounded to four decimals.

Adjusted series:

All stock option and futures series on BANCA MONTE PASCHI SIENA shares at the close of the trading session of 14 October 2022.

Isin code:

- The adjusted series will receive a new ISIN code and their names will receive the "X" suffix;
- The series currently having the "X" suffix will receive a new ISIN code and their names will receive the "Y" suffix.

Early exercise:

Early exercise will be suspended on the 14 October 2022 trading session.

Orders:

The long orders on stock options and futures contracts on BANCA MONTE PASCHI SIENA shares active at the end of the trading session of 14 October 2022 will be deleted.

Communication of the adjusted series:

The adjusted contracts will be available at the following URL at the opening of the trading day on both effective dates:

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