



**Borsa Italiana**

<b>AVVISO</b> <b>n.25376</b>	01 Ottobre 2020	Idem
---------------------------------	-----------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto  
dell'Avviso : BPER BANCA

Oggetto : IDEM: AUMENTO A PAGAMENTO DEL  
CAPITALE SOCIALE SU BPER BANCA:  
IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU  
AZIONI ORDINARIE

*Testo del comunicato*

Si veda allegato.

*Disposizioni della Borsa*

# IDEM

## AUMENTO A PAGAMENTO DEL CAPITALE SOCIALE SU BPER BANCA: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI ORDINARIE

Borsa Italiana diffonde le seguenti disposizioni che avranno efficacia a condizione che entro la mattinata di venerdì 2 ottobre 2020 la società dia comunicazione circa la conclusione dell'iter autorizzativo dell'operazione.

<b>CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA</b>	Contratti futures su azioni ordinarie BPER Banca.
<b>TERMINI DELL'OPERAZIONE</b>	Aumento a pagamento del capitale sociale, come descritto nell'Avviso di Borsa Italiana n. 25197 del 30 settembre 2020.
<b>DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA</b>	Chiusura delle negoziazioni del 2 ottobre 2020.
<b>INTERVENTI DI RETTIFICA</b>	Ai sensi dell'art. IA.8.1.14 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.
<b>DESCRIZIONE DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA</b>	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 <sub>ex</sub> = prezzo "ex diritto" P <sub>cum</sub> = prezzo "cum diritto"
<b>RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI</b>	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ dove: E <sub>cum</sub> = prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica E <sub>ex</sub> = prezzo di chiusura giornaliero dopo la rettifica Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.



<b>RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEI CONTRATTI FUTURES</b>	$A_{ex} = lotto \times \frac{1}{K}$ <p>dove:</p> $A_{ex} = numero\ di\ azioni\ (lotto)\ dopo\ la\ rettifica$
<b>SERIE RETTIFICATE</b>	Tutte le serie di contratti futures su azioni ordinarie BPER Banca in negoziazione al termine della seduta del 2 ottobre 2020.
<b>CODICE ISIN</b>	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 entro la mattina del 5 ottobre 2020: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni ordinarie BPER Banca al termine della seduta di negoziazione del 2 ottobre 2020 saranno cancellati.

Per ulteriori informazioni sugli interventi di rettifica è possibile contattare il mercato IDEM al seguente indirizzo: [IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it](mailto:IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it)

# IDEM

## CAPITAL INCREASE ON BPER BANCA: IMPACT ON STOCK FUTURES CONTRACTS ON ORDINARY SHARES

Borsa Italiana releases the following provisions to be effective subject to the communication of the conclusion of the procedures for the authorization by Friday morning, 2 October 2020.

<b>CONTRACTS TO BE ADJUSTED</b>	Stock futures contracts on BPER Banca ordinary shares.
<b>DETAILS OF THE CORPORATE ACTION</b>	Capital increase, as described in Borsa Italiana's Announcement nr. 25197 dated 30 September 2020.
<b>DATE OF THE ADJUSTMENT</b>	At the close of the trading session on 2 October 2020.
<b>ADJUSTMENT INTERVENTION</b>	According to Borsa Italiana's Instructions, Article IA.8.1.14, the daily closing prices and the number of shares (lot) underlying the stock futures contracts shall be adjusted.
<b>DESCRIPTION OF THE ADJUSTMENT</b>	<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:  <math>P_{ex}</math> = price "ex rights"  <math>P_{cum}</math> = price "cum rights"</p>
<b>ADJUSTMENT OF THE DAILY CLOSING PRICES</b>	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>where:  <math>E_{cum}</math> = daily closing price before the adjustment  <math>E_{ex}</math> = daily closing price after the adjustment</p> <p>Daily closing price shall be rounded to four decimal digits.</p>

<b>ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING STOCK FUTURES</b>	$A_{ex} = lotto \times \frac{1}{K}$ <p>where:</p> $A_{ex} = \text{number of underlying shares (lot) after the adjustment}$
<b>ADJUSTED SERIES</b>	All stock futures on BPER Banca shares open for trade at the close of trading session on 2 October 2020.
<b>ISIN CODE</b>	The adjusted stock futures 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 within the morning of 5 October 2020: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures contracts on BPER Banca ordinary shares active at the end of the trading session of 2 October 2020 will be deleted.

For further information regarding the adjustment intervention, please contact the IDEM market at the following email address: [IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it](mailto:IDEM.corporate-actions@borsaitaliana.it)