

AVVISO n.10667

16 Giugno 2011

Idem

Mittente del comunicato : Borsa Italiana
Societa' oggetto dell'Avviso : BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA
Oggetto : IDEM – CAPITAL INCREASE: IMPACT ON STOCK FUTURES CONTRACTS ON BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA ORDINARY SHARES

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

AUMENTO A PAGAMENTO DEL CAPITALE SOCIALE: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI ORDINARIE BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA

CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA	Contratti futures su azioni ordinarie Banca Monte dei Paschi di Siena.
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Aumento a pagamento del capitale sociale come descritto nell'Avviso di Borsa Italiana n. 10627 del 16 giugno 2011.
DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 17 giugno 2011.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi degli art. IA.9.1.14 comma 1, lettera b) e IA.9.1.14 comma 3 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	<p>L'intervento di rettifica avviene mediante l'applicazione del coefficiente K, calcolato secondo la seguente formula e arrotondato alla sesta cifra decimale:</p> $K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}}$ <p>dove: P_{ex} = prezzo "ex diritto" P_{cum} = prezzo "cum diritto"</p> <p>Si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 10664 del 16 giugno 2011.</p>

<p>RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI</p>	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>dove: E_{cum} = prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica E_{ex} = prezzo di chiusura giornaliero dopo la rettifica</p> <p>Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.</p>
<p>RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEL CONTRATTO FUTURES</p>	$A_{ex} = 1000 \times \frac{1}{K}$ <p>dove: A_{ex} = numero di azioni (lotto) dopo la rettifica</p>
<p>CONTRATTI RETTIFICATI</p>	<p>Tutti i contratti futures su azioni ordinarie Banca Monte dei Paschi di Siena in negoziazione al termine della seduta del 17 giugno 2011. I contratti di nuova generazione manterranno il lotto pari a 1000 azioni ordinarie Banca Monte dei Paschi di Siena.</p>
<p>CODICE ISIN</p>	<p>Le serie rettificate saranno generate con un nuovo codice ISIN e presenteranno una “X” al termine della serie identificativa.</p>

I contratti rettificati saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla serata del 17 giugno 2011: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni ordinarie Banca Monte dei Paschi di Siena al termine della seduta di negoziazione del 17 giugno 2011 saranno cancellati.

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

CAPITAL INCREASE: IMPACT ON STOCK FUTURES CONTRACTS ON BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA ORDINARY SHARES

CONTRACTS TO BE ADJUSTED	Stock futures contracts on Banca Monte dei Paschi di Siena ordinary shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Capital increase as described in Borsa Italiana Announcement nr. 10627 dated June 16 th , 2011.
DATE OF THE ADJUSTMENT	At the close of the trading session on June 17 th , 2011.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, Articles IA.9.1.14 paragraph 1, subparagraph b) and IA.9.1.14 paragraph 3, Borsa Italiana notifies that 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 shall be done by applying the coefficient K calculated according to the following formula and rounded to six decimal places.</p> $K = \frac{P_{ex}}{P_{cum}}$ <p>where: P_{ex} = price "ex rights" P_{cum} = price "cum rights"</p> <p>Please refer to Borsa Italiana Announcement nr. 10664 dated June 16th, 2011.</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 places.</p>

<p>ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING THE STOCK FUTURES CONTRACT</p>	$A_{ex} = 1000 \times \frac{1}{K}$ <p>where: A_{ex} = number of underlying shares (lot) after the adjustment</p>
<p>ADJUSTED CONTRACTS</p>	<p>All stock futures contracts on Banca Monte dei Paschi di Siena ordinary shares open for trade at the close of the trading session on June 17th, 2011.</p> <p>The new contracts will maintain the lot size equal to 1000 Banca Monte dei Paschi di Siena ordinary shares.</p>
<p>ISIN CODE</p>	<p>The adjusted stock futures series will be generated with a new ISIN code and will have an “X” at the end of the series identification code.</p>

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the close of the trading day on June 17th, 2011: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures contracts on Banca Monte dei Paschi di Siena ordinary shares active at the end of the trading session on June 17th, 2011 will be deleted.

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