

**AVVISO
n.1481**

15 Gennaio 2021

Idem

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto : BUZZI UNICEM
dell'Avviso

Oggetto : IDEM - IDEM - EXTRAORDINARY
DIVIDEND DISTRIBUTION: IMPACT ON
STOCK FUTURES CONTRACTS ON
BUZZI UNICEM SHARES

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

IDEM

DISTRIBUZIONE DI UN DIVIDENDO STRAORDINARIO: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI BUZZI UNICEM

CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA	Futures su azioni Buzzi Unicem.
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Distribuzione di un dividendo straordinario pari a 0,75 Euro per azione (si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 847 del 11 gennaio 2021).
DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 29 gennaio 2021.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi dell'articolo IA.8.1.15 delle "Istruzioni al Regolamento dei mercati organizzati e gestiti da Borsa Italiana S.p.A.", l'intervento di rettifica incide sia sul prezzo di chiusura giornaliero che sul numero di azioni (lotto)
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: $K = \frac{P_{last} - \text{dividendo straordinario}}{P_{last}}$ dove: dividendo straordinario = 0,75 Euro
RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ dove: $E_{cum} = \text{prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica}$ $E_{ex} = \text{prezzo di chiusura giornaliero dopo la rettifica}$ Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.



London

Stock Exchange Group

Market Notice



RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI	$A_{ex} = \text{lotto} \times \frac{1}{K}$ dove: $A_{ex} = \text{numero di azioni (lotto) dopo la rettifica}$
CONTRATTI RETTIFICATI	Tutti i contratti futures su azioni Buzzi Unicem in negoziazione al termine della seduta del 29 gennaio 2021. A partire dal 1 febbraio 2021, i contratti di nuova generazione avranno un lotto minimo pari a 100 azioni Buzzi Unicem.
CODICE ISIN	I contratti rettificati saranno generati con un nuovo codice ISIN e presenteranno una "X" al termine della serie identificativa.

I contratti rettificati saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla mattina del 1 febbraio 2021: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni Buzzi Unicem al termine della seduta di negoziazione del 29 gennaio 2021 saranno cancellati.

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

IDEIM

EXTRAORDINARY DIVIDEND DISTRIBUTION: IMPACT ON STOCK FUTURES ON BUZZI UNICEM SHARES

CONTRACTS TO BE ADJUSTED	Stock futures on Buzzi Unicem shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Distribution of an extraordinary dividend of 0.75 Euro per share (please refer to Borsa Italiana Announcement nr. 847 dated 11 January 2021).
DATE OF THE ADJUSTMENT	At the close of the trading session on 29 January 2021.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, article IA.8.1.15, 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 calculated according to the following formula and rounded to six decimal digits.</p> $K = \frac{P_{\text{last}} - \text{extraordinary dividend}}{P_{\text{last}}}$ <p>where:</p> <p>extraordinary dividend = 0.75 Euro</p>
ADJUSTMENT OF THE DAILY CLOSING PRICES	$E_{\text{ex}} = E_{\text{cum}} \times K$ <p>where:</p> <p>E_{cum} = daily closing price before the adjustment</p> <p>E_{ex} = daily closing price after the adjustment</p> <p>Daily closing price shall be rounded to four decimal places.</p>

Market Notice



ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING STOCK FUTURES CONTRACTS	$A_{ex} = \text{lot} \times \frac{1}{K}$ where: $A_{ex} = \text{number of underlying shares (lot) after the adjustment}$
ADJUSTED SERIES	All stock futures on Buzzi Unicem shares open for trade at the close of the trading session on 29 January 2021. Starting from 1 February 2021, new contracts series will have lot size equal to 100 on stock futures on Buzzi Unicem shares.
ISIN CODE	The adjusted stock futures shall be generated with a new ISIN code and will have an "X" at the end.

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the opening of the trading day on 1 February 2021: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures on Buzzi Unicem shares active at the end of the trading session of 29 January 2021 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