



Borsa Italiana

| | | |
|-------------------------|-----------------|------|
| AVVISO n.893 | 12 Gennaio 2021 | Idem |
|-------------------------|-----------------|------|

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto dell'Avviso : FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES

Oggetto : IDEM - EXTRAORDINARY DIVIDEND DISTRIBUTION: IMPACT ON STOCK FUTURES ON FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES SHARES

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

IDEM

DISTRIBUZIONE DI UN DIVIDENDO STRAORDINARIO: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES

| | |
|---|---|
| CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA | Futures su azioni Fiat Chrysler Automobiles. |
| TERMINI DELL'OPERAZIONE | Distribuzione di un dividendo straordinario pari a 1,84 Euro per azione (si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 364 del 5 gennaio 2021). |
| DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA | Chiusura delle negoziazioni del 13 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 sul prezzo di chiusura giornaliero e sul numero di titoli (lotto). |
| 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> $K = \frac{P_{last} - \text{dividendo straordinario}}{P_{last}}$ <p>dove: dividendo straordinario = 1,84 Euro</p> |
| RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI | $E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>dove:</p> $E_{cum} = \text{prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica}$ $E_{ex} = \text{prezzo di chiusura giornaliero dopo la rettifica}$ <p>Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.</p> |

| | |
|---|--|
| RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI | $A_{ex} = \text{lotto} \times \frac{1}{K}$ <p>dove:</p> $A_{ex} = \text{numero di azioni (lotto) dopo la rettifica}$ |
| CONTRATTI RETTIFICATI | Tutti i contratti futures su azioni Fiat Chrysler Automobiles in negoziazione al termine della seduta del 13 gennaio 2021. A partire dal 14 gennaio 2021, i contratti di nuova generazione avranno un lotto minimo pari a 500 azioni. |
| 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 14 gennaio 2021: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni Fiat Chrysler Automobiles al termine della seduta di negoziazione del 13 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

IDEM

EXTRAORDINARY DIVIDEND DISTRIBUTION: IMPACT ON STOCK FUTURES ON FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES SHARES

| | |
|---|--|
| CONTRACTS TO BE ADJUSTED | Stock futures on Fiat Chrysler Automobiles shares. |
| DETAILS OF THE CORPORATE ACTION | Distribution of an extraordinary dividend of 1.84 Euro per share (please refer to Borsa Italiana Announcement nr. 364 dated 5 January 2021). |
| DATE OF THE ADJUSTMENT | At the close of the trading session on 13 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> $K = \frac{P_{last} - \text{extraordinary dividend}}{P_{last}}$ <p>where: extraordinary dividend = 1.84 Euro</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> |

| | |
|--|---|
| ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING STOCK FUTURES CONTRACTS | $A_{ex} = \text{lot} \times \frac{1}{K}$ <p>where:</p> <p><i>A_{ex}</i> = number of underlying shares (lot) after the adjustment</p> |
| ADJUSTED SERIES | All stock futures on Fiat Chrysler Automobiles shares open for trade at the close of the trading session on 13 January 2021. Starting from 14 January 2021, new contracts series will have the lot size equal to 500 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 14 January 2021: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures on Fiat Chrysler Automobiles shares active at the end of the trading session of 13 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