



Borsa Italiana

AVVISO n.12256	15 Aprile 2021	Idem
---------------------------	----------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto
dell'Avviso : STELLANTIS

Oggetto : IDEM - EXTRAORDINARY DIVIDEND
DISTRIBUTION: IMPACT ON STOCK
FUTURES AND STOCK DIVIDEND
FUTURES ON STELLANTIS SHARES

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Annulla e sostituisce l'avviso n. 12244 del 15/04/2021.

Cancel and replace the announcement n. 12244 of April 15, 2021.

IDEM

DISTRIBUZIONE DI UN DIVIDENDO STRAORDINARIO: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI E FUTURES SU DIVIDENDI DI AZIONI STELLANTIS

CONTRATTI OGGETTO DI RETTIFICA	<ul style="list-style-type: none"> • Futures su azioni Stellantis; • Futures su dividendi di azioni Stellantis.
TERMINI DELL'OPERAZIONE	Distribuzione di un dividendo straordinario pari a € 0,32 per ciascuna azione ordinaria Stellantis detenuta (si veda l'Avviso di Borsa Italiana n. 12253 del 15 aprile 2021).
DATA DI EFFICACIA DELL'INTERVENTO DI RETTIFICA	Chiusura delle negoziazioni del 16 aprile 2021.
INTERVENTI DI RETTIFICA	Ai sensi degli articoli IA.8.1.6 e 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 dei contratti futures che sul loro 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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) P_{last} prezzo dell'ultimo contratto delle azioni ordinarie STELLANTIS su Borsa Italiana nel giorno di borsa antecedente lo stacco del dividendo 2) dividendo straordinario = € 0,32
RETTIFICA DEI PREZZI DI CHIUSURA GIORNALIERI	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>dove:</p>

	E_{cum} = prezzo di chiusura giornaliero prima della rettifica E_{ex} = prezzo di chiusura giornaliero dopo la rettifica Il prezzo di chiusura giornaliero viene arrotondato alla quarta cifra decimale.
RETTIFICA DEL NUMERO DI AZIONI (LOTTO) OGGETTO DEI CONTRATTI FUTURES SU AZIONI E FUTURES SU DIVIDENDI DI AZIONI	$A_{ex} = \text{lotto} \times \frac{1}{K}$ dove: A_{ex} = numero di azioni (lotto) dopo la rettifica
CONTRATTI RETTIFICATI	Tutti i contratti futures su azioni e futures su dividendi di azioni Stellantis in negoziazione al termine della seduta del 16 aprile 2021. A partire dal 19 aprile 2021, i contratti di nuova generazione avranno un lotto minimo pari a: <ul style="list-style-type: none">• 500 sui contratti futures su azioni Stellantis;• 10.000 sui contratti futures su dividendi di azioni Stellantis.
CODICE ISIN	I contratti rettificati saranno generati con un nuovo codice ISIN e presenteranno una "X" al termine della serie identificativa. Le serie precedentemente rettificate che presentano una "Y" avranno un nuovo codice ISIN e una "Z" finale.

I contratti rettificati saranno disponibili sul web al seguente indirizzo internet a partire dalla mattina del 19 aprile 2021:
<http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.htm>

Gli eventuali *long order* presenti sui book dei contratti futures su azioni e futures su dividendi di azioni Stellantis al termine della seduta di negoziazione del 16 aprile 2021 saranno cancellati.

IDEM

EXTRAORDINARY DIVIDEND DISTRIBUTION: IMPACT ON STOCK FUTURES AND STOCK DIVIDEND FUTURES ON STELLANTIS SHARES

CONTRACTS TO BE ADJUSTED	<ul style="list-style-type: none"> • Stock futures on Stellantis shares; • Stock dividend futures on Stellantis shares.
DETAILS OF THE CORPORATE ACTION	Distribution of an extraordinary dividend of € 0.32 for each Stellantis ordinary share held (please refer to Borsa Italiana Announcement nr. 12253 dated 15 April 2021).
DATE OF THE ADJUSTMENT	At the close of the trading session on 16 April 2021.
ADJUSTMENT INTERVENTION	According to Borsa Italiana's Instructions, articles IA.8.1.6 and IA.8.1.15, the daily closing prices and the number of shares (lot) underlying both 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:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) P_{last}: the last price of STELLANTIS ordinary shares on Borsa Italiana on the day before the dividend detachment date 2) extraordinary dividend = € 0.32.
ADJUSTMENT OF THE DAILY CLOSING PRICES	$E_{ex} = E_{cum} \times K$ <p>where:</p> <p>E_{cum} = daily closing price before the adjustment</p> <p>E_{ex} = daily closing price after the adjustment</p>

	Daily closing price shall be rounded to four decimal places.
ADJUSTMENT OF THE NUMBER OF SHARES (LOT) UNDERLYING STOCK FUTURES AND STOCK DIVIDEND 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	<p>All stock futures and stock dividend futures on Stellantis shares open for trade at the close of the trading session on 16 April 2021.</p> <p>Starting from 19 April 2021, new contracts series will have lot size equal to:</p> <ul style="list-style-type: none">• 500 on stock futures on Stellantis shares;• 10,000 on stock dividend futures on Stellantis shares.
ISIN CODE	<p>The adjusted stock futures and stock dividend futures shall be generated with a new ISIN code and will have an "X" at the end.</p> <p>The previously adjusted series with a final "Y" will be generated with a new ISIN code and will have only a "Z" at the end.</p>

The adjusted contracts will be available on our web site at the following URL at the opening of the trading day on 19 April 2021: <http://www.borsaitaliana.it/derivati/primopiano/serierettificate.en.htm>

The long orders on stock futures and stock dividend futures on Stellantis shares active at the end of the trading session of 16 April 2021 will be deleted.