



Borsa Italiana

AVVISO n.13458	23 Aprile 2021	Idem
---------------------------	----------------	------

Mittente del comunicato : BORSA ITALIANA

Societa' oggetto
dell'Avviso : CREDITO VALTELLINESE

Oggetto : IDEM - CVAL: THEORETICAL FAIR
VALUE

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

IDEM

THEORETICAL FAIR VALUE (TFV)

Milano, 23 aprile 2021 – Con riferimento all’avviso n. 13031 del 21 aprile 2021, si comunica che, a seguito dell’esito dell’Opa su azioni ordinarie Credito Valtellinese, si procede alla chiusura e liquidazione monetaria (tramite la metodologia del Theoretical Fair Value) dei relativi contratti di opzione risultanti aperti alla data odierna.

I prezzi di liquidazione dei contratti derivati su azioni Credito Valtellinese verranno pubblicati con Avviso di Borsa Italiana nella giornata di lunedì 26 aprile 2021.

La liquidazione degli importi monetari risultanti dall’applicazione del TFV verrà effettuata da Cassa di Compensazione e Garanzia nella giornata di martedì 27 aprile 2021.

THEORETICAL FAIR VALUE (TFV)

Milan, 23 April 2021 – With reference to Borsa Italiana’s Announcement n. 13031 dated 21 April 2021, considering the outcome of the public tender offer period, Borsa Italiana informs that open positions on option contracts on Credito Valtellinese ordinary shares at the close of the current trading session will be closed and cash settled (via the Theoretical Fair Value methodology).

The settlement prices of single names derivatives on Credito Valtellinese shares will be published on Monday 26 April 2021 via Borsa Italiana’s Announcement.

The cash settlement amounts resulting from the TFV methodology will be settled by Cassa di Compensazione e Garanzia on Tuesday 27 April 2021.