

3 Gennaio 2022

Notice – BASKET su Contratti di Opzione e Futures su Azioni CNHI: STRIKE RATIO

To the attention of:	Partecipanti IDEM
Priority:	Medium
Topic:	IDEM – BASKET su contratti di Opzione e Futures su Azioni CNHI: STRIKE RATIO

Si fa seguito al precedente Comunicato della scrivente datato 23 dicembre 2021 relativo all'Operazione sul Capitale descritta negli Avvisi di Borsa Italiana n.37591, n.37680 e n.37681 del 12 novembre 2021, per comunicare il valore dello **"strike ratio"**¹ è pari a 0,87.

Pertanto il controvalore da liquidare in T2S per futures in consegna ed esercizi/assegnazioni relativi alle serie CNHI (classe CNHI1, 2CNHI1 e 3CNHI1) sarà ripartito tra i due titoli del basket, attribuendo alle CNHI (ISIN NL0010545661) **l'87%** del prezzo di esercizio (c.d. "strike ratio") ed alle IVG (ISIN NL0015000LU4) **il 13%** del prezzo di esercizio.

¹ CC&G si riserva la facoltà di rivedere la misura dello strike ratio dandone informazione con apposito Comunicato.

Per ulteriori informazioni contattare:

Euronext Clearing Operations

T: +39 06 32395321/303

E: ccg-operations@euronext.com

This publication is for information purposes only and is not a recommendation to engage in investment activities. This publication is provided "as is" without representation or warranty of any kind. Whilst all reasonable care has been taken to ensure the accuracy of the content, Euronext does not guarantee its accuracy or completeness. Euronext will not be held liable for any loss or damages of any nature ensuing from using, trusting or acting on information provided. No information set out or referred to in this publication shall form the basis of any contract. The creation of rights and obligations in respect of financial products that are traded on the exchanges operated by Euronext's subsidiaries shall depend solely on the applicable rules of the market operator. All proprietary rights and interest in or connected with this publication shall vest in Euronext. No part of it may be redistributed or reproduced in any form without the prior written permission of Euronext.

Euronext refers to Euronext N.V. and its affiliates. Information regarding trademarks and intellectual property rights of Euronext is located at euronext.com/terms-use.

© 2022, Euronext N.V. - All rights reserved.