

09 December 2021

Comunicato – Operazione di rettifica Comparto Derivati Azionari

To the attention of:	Partecipanti ai Comparti Derivati
Priority:	Media
Topic:	IDEM - ASSEGNAZIONE DI AZIONI ORDINARIE DAIMLER TRUCK HOLDING : Impatto sui contratti Futures su Dividendi di Azioni Ordinarie DAIMLER (1DAI)

Premessa

A decorrere da venerdì 10 Dicembre 2021 avrà efficacia in Borsa l'operazione di Assegnazione di Azioni Ordinarie Dailmer Truck Holding con impatto sui contratti Futures su dividendi Dailmer (1DAI). L'intervento di rettifica prevede la sostituzione dei dividendi delle azioni DAIMLER oggetto dei contratti futures su dividendi con un paniere composto da dividendi di azioni ordinarie DAIMLER TRUCK HOLDING e DAIMLER .

Per la gestione si terrà conto delle disposizioni dei nuovi termini dell'operazione dell'avviso di Borsa Italiana n° 40708 del 06 Dicembre 2021 e secondo le modalità dell'art. B.3.1.6. del Regolamento di Euronext Clearing.

1. Operazione di rettifica

Al termine della sessione odierna p.v. e dopo l'elaborazione del Batch serale, le posizioni aperte saranno rettificate come di seguito riportato.

- **Posizioni futures su dividendi 1DAI**
- **Posizioni futures su dividendi 1DAI1**

Ai sensi dell'articolo IA 8.1.6. comma 6 delle "Istruzioni al regolamento dei mercati organizzati e gestiti da Borsa Italiana S.p.a.", l'intervento di rettifica incide sul loro numero di titoli (lotto).

L'intervento di rettifica avviene mediante creazione del seguente basket sui contratti esistenti:

- a) Per la serie (**1DAI**) con lotto **10.000 azioni DAI**:

$$\text{LOT}_{\text{basket}}^1 = \mathbf{10.000 \text{ azioni DAI} + 5.000 \text{ azioni DAIMLER TRUCK HOLDING}}$$

- b) Per le serie (**1DAI1**) con lotto **1.000 azioni DAI**:

$$\text{LOT}_{\text{basket}} = \mathbf{1.000 \text{ azioni DAI} + 500 \text{ azioni DAIMLER TRUCK HOLDING}}$$

Di seguito si descrivono gli interventi che dovranno essere effettuati nei sistemi di Back Office dai Partecipanti che replicano la metodologia dei margini di CC&G.

2) Classificazione delle posizioni con consegna fisica e cash

Le posizioni Options and Futures saranno identificate nei *reports di Clearing* come indicato nella tabella seguente:

<i>Up to the last cum trading day (included)</i>			<i>Starting from the first ex trading day (included)</i>				
<i>Description</i>	<i>Multiplier</i>	<i>Class Symbol</i>	<i>Description</i>	<i>Multiplier</i>	<i>Class Symbol</i>	<i>Class Group</i>	<i>Product Group</i>
DAIMLER Stock Dividend Future XC000A1DKDA5	10000	1DAI	DAIMLER Stock Dividend Future Adjusted XC000A1DKDA5	(10.000 shares DAI + 5.000 shares Daimler Truck Holding)	1DAI1	1DAI	1DA
DAIMLER Stock Dividend Future Adjusted XC000A1DKDA5	1000	1DAI1	DAIMLER Stock Dividend Future Second Adjusted XC000A1DKDA5	(1000 shares DAI + 500 shares Daimler Truck Holding)	1DAI2	1DAI	1DA
Series that will be generated			DAIMLER Stock Dividend Future XC000A1DKDA5	EX 10000	1DAI	1DAI	1DA

¹ LOT_{basket} = numero di azioni (lotto) dopo la rettifica

Per le serie rettificate verranno applicati i medesimi parametri dei margini previsti per le serie non rettificate.