

10 Dicembre 2021

Notice – ASSEGNAZIONE DI AZIONI ORDINARIE MFE A: IMPATTO SUI CONTRATTI DI OPZIONE E FUTURES SU AZIONI MFE B

To the attention of:	Partecipanti IDEM
Priority:	Medium
Topic:	IDEM – Assegnazione di Azioni ordinarie MFE A: Impatto su contratti Futures e Options su Azioni MFE B

Premessa

A decorrere da lunedì 13 Dicembre 2021 avrà efficacia in Borsa l'operazione di Assegnazione delle azioni ordinarie MFE A con impatto sui contratti futures e di opzioni ordinarie MFE B.

L'intervento di rettifica prevede la sostituzione delle azioni MFE B oggetto dei contratti di opzione e futures con un paniere composto da azioni ordinarie MFE A e MFE B secondo le modalità degli Avvisi di Borsa Italiana n. 40516, n. 40582 e n. 40583 del 6 Dicembre 2021, e dell'art. B.3.1.7. del Regolamento di CC&G.

1. Operazione di Rettifica

Al termine della sessione di venerdì 10 Dicembre 2021 e dopo l'elaborazione del Batch serale, le posizioni aperte saranno rettificate come di seguito riportato:

1.1 Options positions:

- a. prezzi di esercizio rimarranno invariati;
- b. l'attività sottostante dei contratti rettificati con lotto pari a 1000 (MFEB) sarà posta pari a 1000 azioni MFEB ex assegnazione + 1000 azioni MFEA;
- c. l'attività sottostante dei contratti rettificati con lotto pari a 1106 (MFEB1) sarà posta pari a 1106 azioni MFEB ex assegnazione + 1106 azioni MFEA;
- d. a partire dal 13 Dicembre 2021, le serie di nuova generazione avranno lotto minimo pari a 1000 azioni MFEB.

1.2 Futures positions

- a) I prezzi di regolamento giornaliero rimarranno invariati
- b) l'attività sottostante dei contratti rettificati con lotto pari a 1000 (MFEB) sarà posta pari a 1000 azioni MFEB ex assegnazione + 1000 azioni MFEA;
- c) partire dal 13 Dicembre 2021, le serie di nuova generazione avranno lotto minimo pari a 1000 azioni MFEB.

Di seguito si descrivono gli interventi che dovranno essere effettuati nei sistemi di Back Office dai Partecipanti.

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.

1.3 Classificazione delle posizioni e parametri dei margini

Le posizioni in opzioni e in futures saranno classificate nei reports di Clearing come indicato nella tabella seguente:

Up to the last cum trading day (included)			Starting from the first ex trading day (included)				
Description	Number of Underlying Shares	Class Symbol	Description	Number of Underlying Shares	Class Symbol	Class Group	Product Group
MFE B Ordinary Shares	1000 ISIN: NL0015000N09	MFEB	MFE B Adjusted Ordinary Shares	1000 MFEB Ex-assignment + 1000 MFEA	MFEB1	MFEB1	MEB
MFE B Adjusted Ordinary Shares	1000 ISIN: NL0015000N09	MFEB1	MFE B Adjusted ² Ordinary Shares	1106 MFEB Ex-assignment + 1106 MFEA	MFEB2	MFEB2	MEB
MFE B Stock Futures cash	1000 ISIN: NL0015000N09	2MFEB	MFE B Stock Futures cash Adjusted	1000 MFEB Ex-assignment + 1000 MFEA	2MFEB1	MFEB1	MEB
Series that will be generated			MFE B Ordinary Shares & Stock Futures Cash	1000 MFEB 1000 2MFEB Ex NL0015000N09	MFEB 2MFEB	MFEB	MED

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](https://www.euronext.com/terms-use).

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

Codici ISIN sigle delle Azioni:

- Le Azioni Ordinarie A saranno identificate con il codice ISIN **NL0015000MZ1** e dalla sigla **"MFEA"**.
- Le Azioni Ordinarie B saranno identificate con il codice ISIN **NL0015000N09** e dalla sigla **"MFEB"**.

2. Consegna fisica

In caso di esercizio e/o assegnazione, sia anticipato che a scadenza, di opzioni o di consegna fisica di futures facenti parte della Classe "MFEB1", "MFEB2", "2MFEB1" (rettificate), l'obbligo di consegna sarà riferito a quanto descritto nel paragrafo 1).

Il controvalore da liquidare sarà ripartito tra i due titoli attribuendo alle MFEB ex assegnazione e alle MFEA una percentuale del prezzo di esercizio (cd strike ratio). Lo strike ratio verrà comunicato lunedì 13 Dicembre p.v..

L'esercizio anticipato è sospeso oggi **10 Dicembre 2021.**

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.