
Comunicato – Operazione di rettifica Comparto Derivati Azionari

25 Settembre 2020

SCISSIONE DI SIEMENS AG IN FAVORE DI SIEMENS ENERGY AG: IMPATTO SUI CONTRATTI FUTURES SU DIVIDENDI DI AZIONI ORDINARIE SIEMENS AG (1SIE)

Premessa

A decorrere da lunedì 28 settembre 2020 avrà efficacia in Borsa l'operazione di Scissione di Siemens AG (Siemens) in favore di Siemens Energy AG mediante assegnazione agli azionisti Siemens di 1 nuova azione Siemens Energy per ogni 2 azioni Siemens secondo le modalità degli Avvisi di Borsa Italiana n. 24246 del 21 settembre 2020, n. 24583 del 24 settembre 2020 e dell'art. B.3.1.6. del Regolamento di CC&G.

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 1SIE**

Ai sensi dell'articolo IA.8.1.14 delle "Istruzioni al Regolamento dei mercati organizzati e gestiti da Borsa Italiana S.p.A.", la rettifica prevede la sostituzione del sottostante con un paniere contenente i dividendi di Siemens AG e i dividendi di Siemens Energy in proporzione al rapporto di scissione

Rettifica del numero di azioni : $Aex = (1000 \text{ azioni Siemens} + 500 \text{ azioni Siemens Energy})$

(Aex= numero di azioni lotto dopo la rettifica)

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 e parametri dei margini

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



London
Stock Exchange Group

Operazione di rettifica

Comparto Derivati Azionari

25 Settembre 2020

<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>
SIEMENS AG Stock Dividend Future XC000A1CRLR9	1000	1SIE	SIEMENS AG Stock Dividend Future Adjusted XC000A1CRLR9	(1000 azioni Siemens + 500 azioni Siemens Energy)	1SIE1	1SIE	1SIE
Series that will be generated			SIEMENS AG Stock Dividend Future XC000A1CRLR9	EX 1000	1SIE	1SIE	1SIE

I parametri dei margini per la classe 1SIE1 saranno gli stessi applicati per la classe 1SIE.

Operazione di rettifica

Comparto Derivati Azionari

25 Settembre 2020