

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES

Dirección General de Mercados

Paseo de la Castellana, 15

28046 Madrid

COMUNICACIÓN DE HECHO RELEVANTE



BNP PARIBAS

NOTIFICA

EVENTO EXTRAORDINARIO

Bolsas y Mercados Españoles S.A. realizará la entrega de un pago especial.

Nombre Compañía: Bolsas y Mercados Españoles S.A.

Reuters: BME.MC

Bloomberg: BME SM

ISIN: ES0115056139

Términos:

Fecha de Registro: 26/06/13

Fecha ExDate: 27/06/13

Pago Especial: 0.372 EUR por acción

Precio de Cierre de BME en la Fecha de Registro (26/06/13): 19.05 EUR

EMISIONES AFECTADAS

Este evento extraordinario afectará a los siguientes instrumentos emitidos por BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.:

	SIBE	ISIN	Producto	Call/Put	Subyacente	Precio de Ejercicio	Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	D1281	NL0010339578	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 22	5	0.2	20/09/2013
2	D1282	NL0010339586	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 23	5	0.2	20/12/2013
3	D1283	NL0010339594	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 24	5	0.2	20/09/2013
4	D1284	NL0010339602	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 19	5	0.2	19/12/2013
5	D1285	NL0010339610	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 20	5	0.2	19/09/2013
6	D3342	NL0010394425	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 20	5	0.2	20/09/2013
7	D3343	NL0010394433	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 21	5	0.2	20/12/2013
8	D3344	NL0010394441	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 17	5	0.2	19/12/2013
9	D3345	NL0010394458	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 18	5	0.2	19/09/2013

AJUSTE

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. aplicará el siguiente Factor de Ajuste sobre las características de las emisiones anteriores para que este evento extraordinario tenga un efecto económicamente neutral:

$$\text{Factor de Ajuste} = \frac{\left(\begin{array}{l} \text{Precio de Cierre} \\ \text{de BME en la} \\ \text{Fecha de Registro} \end{array} - \text{Pago Especial} \right)}{\begin{array}{l} \text{Precio de Cierre} \\ \text{de BME en la} \\ \text{Fecha de Registro} \end{array}} =$$

$$= \frac{19.05 \text{ EUR} - 0.372 \text{ EUR}}{19.05 \text{ EUR}} = 0.98047244$$

Nuevo Precio de Ejercicio (redondeado a 2 decimales) = Viejo Precio de Ejercicio x Factor de Ajuste

Nueva Paridad (redondeada a 4 decimales) = Vieja Paridad x Factor de Ajuste

Nuevo Ratio (redondeado a 4 decimales) = 1 / Nueva Paridad

NUEVAS CARACTERÍSTICAS DE LAS EMISIONES AFECTADAS
--

Una vez aplicado el ajuste anterior sobre las características de las citadas emisiones, éstas tendrán las siguientes características a partir del 27/06/13 (incluido):

	SIBE	ISIN	Producto	Call/Put	Subyacente	Precio de Ejercicio	Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	D1281	NL0010339578	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 21.57	4.9024	0.204	20/09/2013
2	D1282	NL0010339586	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 22.55	4.9024	0.204	20/12/2013
3	D1283	NL0010339594	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 23.53	4.9024	0.204	20/09/2013
4	D1284	NL0010339602	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 18.63	4.9024	0.204	19/12/2013
5	D1285	NL0010339610	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 19.61	4.9024	0.204	19/09/2013
6	D3342	NL0010394425	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 19.61	4.9024	0.204	20/09/2013
7	D3343	NL0010394433	WARRANT	CALL	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 20.59	4.9024	0.204	20/12/2013
8	D3344	NL0010394441	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 16.67	4.9024	0.204	19/12/2013
9	D3345	NL0010394458	WARRANT	PUT	Bolsas y Mercados Españoles SA	EUR 17.65	4.9024	0.204	19/09/2013

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. comunica lo anterior para conocimiento del público en general a los efectos oportunos.

En Madrid a 26 de Junio de 2013