

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

Merlin Properties Socimi SA realizará la entrega de un pago especial.

Nombre Compañía: Merlin Properties Socimi SA

Reuters: MRL.MC

Bloomberg: MRL:SQ

ISIN: ES0105025003

Fecha de Registro: 03/08/22

Fecha ExDate: 04/08/22

Pago Especial: 0.750 EUR por acción

Precio de Cierre de Merlin Properties Socimi SA en la Fecha de Registro (03/08/22): 10.44 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	J5412	NLBNPES15JR7	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 8.5	2	0.5	16/09/2022
2	J5408	NLBNPES15JN6	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 9.5	2	0.5	16/09/2022
3	J6679	NLBNPES163G3	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 9.5	2	0.5	16/09/2022
4	J6680	NLBNPES163H1	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 10	2	0.5	16/09/2022
5	J6681	NLBNPES163I9	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 10	2	0.5	16/12/2022
6	J6676	NLBNPES163D0	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 11	2	0.5	16/09/2022
7	J6677	NLBNPES163E8	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 11	2	0.5	16/12/2022
8	J6678	NLBNPES163F5	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 11.5	2	0.5	16/09/2022

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:

$$\text{Factor de Ajuste} = 1 - \frac{\text{Dividendo Extraordinario}}{\text{Precio de Cierre en la Fecha de Registro}}$$

$$\text{Factor de Ajuste} = 1 - (0.75 \text{ euros} / 10.4400 \text{ euros}) = \mathbf{0.92816092}$$

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 04/08/22 (incluido):

	SIBE	ISIN	Producto	Call/Put	Subyacente	Nuevo Precio de Ejercicio	Nueva Paridad	Nuevo Ratio	Fecha de Vencimiento
1	J5412	NLBNPES15JR7	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 7.89	1.8563	0.5387	16/09/2022
2	J5408	NLBNPES15JN6	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 8.82	1.8563	0.5387	16/09/2022
3	J6679	NLBNPES163G3	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 8.82	1.8563	0.5387	16/09/2022
4	J6680	NLBNPES163H1	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 9.28	1.8563	0.5387	16/09/2022
5	J6681	NLBNPES163I9	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 9.28	1.8563	0.5387	16/12/2022
6	J6676	NLBNPES163D0	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 10.21	1.8563	0.5387	16/09/2022
7	J6677	NLBNPES163E8	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 10.21	1.8563	0.5387	16/12/2022
8	J6678	NLBNPES163F5	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 10.67	1.8563	0.5387	16/09/2022

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

En Madrid a 3 de Agosto de 2022