

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

Industria de diseño textil, S.A. realizará la entrega de un pago especial.

Nombre Compañía: Industria de diseño textil, S.A.

Reuters: ITX.MC

Bloomberg: ITX:SM

ISIN: ES0148396007

Fecha de Registro: 28/04/21

Fecha ExDate: 29/04/21

Dividendo Ordinario: 0.220 EUR por acción

Pago Especial: 0.130 EUR por acción

Precio de Cierre de Industria de diseño textil, S.A. en la Fecha de Registro (28/04/21): 29.81 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	J0101	NLBNPES10KO3	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 21.65	5	0.2	18/03/2022
2	J0102	NLBNPES10KP0	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 20.66	5	0.2	18/03/2022
3	H9048	NLBNPES106N8	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 22.5	5	0.2	17/12/2021
4	H9050	NLBNPES106P3	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 25.32	5	0.2	18/06/2021
5	H7268	NL0013993694	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 20	5	0.2	18/06/2021
6	H7267	NL0013993686	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 40	5	0.2	17/12/2021
7	H7269	NL0013993702	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 20	5	0.2	17/12/2021
8	H7970	NL0014557886	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 22.4	5	0.2	18/06/2021
9	H7972	NL0014557902	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 25.43	5	0.2	17/09/2021
10	H7264	NL0013993652	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 30	5	0.2	18/06/2021
11	H7266	NL0013993678	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 40	5	0.2	18/06/2021
12	H7265	NL0013993660	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 30	5	0.2	17/12/2021
13	J0089	NLBNPES10KC8	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 35.42	5	0.2	18/03/2022
14	J0090	NLBNPES10KD6	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 33.45	5	0.2	18/03/2022
15	H9040	NLBNPES106F4	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 25.43	5	0.2	17/12/2021

16	H9043	NLBNPES106I8	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.28	5	0.2	18/06/2021
17	J0091	NLBNPES10KE4	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 32.28	5	0.2	17/09/2021
18	J0092	NLBNPES10KF1	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 32.28	5	0.2	17/12/2021
19	J0093	NLBNPES10KG9	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 30.5	5	0.2	18/03/2022
20	J0094	NLBNPES10KH7	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 30.5	5	0.2	18/03/2022
21	J0095	NLBNPES10KI5	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.54	5	0.2	18/03/2022
22	J0096	NLBNPES10KJ3	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 27.54	5	0.2	18/03/2022
23	H9044	NLBNPES106J6	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.4	5	0.2	17/09/2021
24	H7962	NL0014557803	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 25.32	5	0.2	18/06/2021
25	H9047	NLBNPES106M0	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 22.5	5	0.2	17/09/2021
26	H7963	NL0014557811	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 25.43	5	0.2	17/09/2021
27	H7271	NL0013993728	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 30	5	0.2	18/06/2021
28	H7965	NL0014557837	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 30.33	5	0.2	17/09/2021
29	H7272	NL0013993736	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 30	5	0.2	17/12/2021
30	H7967	NL0014557852	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 21.53	5	0.2	17/09/2021
31	H7968	NL0014557860	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 21.53	5	0.2	17/12/2021
32	J0097	NLBNPES10KK1	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.4	5	0.2	17/12/2021
33	J0098	NLBNPES10KL9	WARRANT	PUT	Industria de diseño	EUR 27.4	5	0.2	17/12/2021

					textile				
34	J0099	NLBNPES10KM7	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 25	5	0.2	18/03/2022
35	J0100	NLBNPES10KN5	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 25	5	0.2	18/03/2022

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:

$$\text{Factor de Ajuste} = \frac{\left(\text{Precio de Cierre en la Fecha de Registro} - \text{Dividendo Ordinario} \right) - \text{Dividendo Extraordinario}}{\text{Precio de Cierre en la Fecha de Registro} - \text{Dividendo Ordinario}}$$

Factor de Ajuste = ((29.81 euros – 0.2200 euros) – 0.1300 euros) / (29.81 – 0.2200 euros) = 0.99560662

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 29/04/21 (incluido):

	SIBE	ISIN	Producto	Call/Put	Subyacente	Nuevo Precio de Ejercicio	Nueva Paridad	Nuevo Ratio	Fecha de Vencimiento
1	J0101	NLBNPES10KO3	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 21.55	4.9780	0.2009	18/03/2022
2	J0102	NLBNPES10KP0	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 20.57	4.9780	0.2009	18/03/2022
3	H9048	NLBNPES106N8	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 22.4	4.9780	0.2009	17/12/2021
4	H9050	NLBNPES106P3	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 25.21	4.9780	0.2009	18/06/2021
5	H7268	NL0013993694	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 19.91	4.9780	0.2009	18/06/2021
6	H7267	NL0013993686	WARRANT	CALL	Industria de diseño	EUR 39.82	4.9780	0.2009	17/12/2021

					textile				
7	H7269	NL0013993702	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 19.91	4.9780	0.2009	17/12/2021
8	H7970	NL0014557886	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 22.3	4.9780	0.2009	18/06/2021
9	H7972	NL0014557902	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 25.32	4.9780	0.2009	17/09/2021
10	H7264	NL0013993652	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 29.87	4.9780	0.2009	18/06/2021
11	H7266	NL0013993678	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 39.82	4.9780	0.2009	18/06/2021
12	H7265	NL0013993660	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 29.87	4.9780	0.2009	17/12/2021
13	J0089	NLBNPES10KC8	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 35.26	4.9780	0.2009	18/03/2022
14	J0090	NLBNPES10KD6	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 33.3	4.9780	0.2009	18/03/2022
15	H9040	NLBNPES106F4	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 25.32	4.9780	0.2009	17/12/2021
16	H9043	NLBNPES106I8	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.16	4.9780	0.2009	18/06/2021
17	J0091	NLBNPES10KE4	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 32.14	4.9780	0.2009	17/09/2021
18	J0092	NLBNPES10KF1	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 32.14	4.9780	0.2009	17/12/2021
19	J0093	NLBNPES10KG9	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 30.37	4.9780	0.2009	18/03/2022
20	J0094	NLBNPES10KH7	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 30.37	4.9780	0.2009	18/03/2022
21	J0095	NLBNPES10KI5	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.42	4.9780	0.2009	18/03/2022
22	J0096	NLBNPES10KJ3	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 27.42	4.9780	0.2009	18/03/2022
23	H9044	NLBNPES106J6	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.28	4.9780	0.2009	17/09/2021
24	H7962	NL0014557803	WARRANT	CALL	Industria	EUR 25.21	4.9780	0.2009	18/06/2021

					de diseño textil				
25	H9047	NLBNPES106M0	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 22.4	4.9780	0.2009	17/09/2021
26	H7963	NL0014557811	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 25.32	4.9780	0.2009	17/09/2021
27	H7271	NL0013993728	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 29.87	4.9780	0.2009	18/06/2021
28	H7965	NL0014557837	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 30.2	4.9780	0.2009	17/09/2021
29	H7272	NL0013993736	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 29.87	4.9780	0.2009	17/12/2021
30	H7967	NL0014557852	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 21.44	4.9780	0.2009	17/09/2021
31	H7968	NL0014557860	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 21.44	4.9780	0.2009	17/12/2021
32	J0097	NLBNPES10KK1	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 27.28	4.9780	0.2009	17/12/2021
33	J0098	NLBNPES10KL9	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 27.28	4.9780	0.2009	17/12/2021
34	J0099	NLBNPES10KM7	WARRANT	CALL	Industria de diseño textil	EUR 24.89	4.9780	0.2009	18/03/2022
35	J0100	NLBNPES10KN5	WARRANT	PUT	Industria de diseño textil	EUR 24.89	4.9780	0.2009	18/03/2022

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

En Madrid a 28 de Abril de 2021