

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

Viscofan, S.A. realizará la entrega de un pago especial.

Nombre Compañía: Viscofan SA
Reuters: VIS.MC
Bloomberg: VIS:SM
ISIN: ES0184262212

Fecha de Registro: 27/05/24
Fecha ExDate: 28/05/24
Dividendo Ordinario: 0,596 EUR por acción
Pago Especial: 1,00 EUR por acción
Precio de Cierre de Viscofan SA en la Fecha de Registro (27/05/24): 63,00 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	K7312	NLBNPES18U88	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR 56	10	0.1	21/06/2024
2	K7313	NLBNPES1N2U1	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR 56	10	0.1	20/09/2024
3	K7314	NLBNPES1LBC7	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR 58	10	0.1	20/09/2024
4	K5699	NLBNPES19MR3	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR 60	10	0.1	21/06/2024
5	K5700	NLBNPES1A9S5	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR 65	10	0.1	21/06/2024
6	K7317	NLBNPES1MGZ5	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR 46	10	0.1	21/06/2024
7	K7318	NLBNPES1N6D8	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR 48	10	0.1	21/06/2024
8	K7319	NLBNPES1JEX1	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR 48	10	0.1	20/09/2024
9	K7320	NLBNPES1PL01	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR 50	10	0.1	20/09/2024
10	K5705	NLBNPES1HRO6	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR 52	10	0.1	21/06/2024
11	K5706	NLBNPES1Z6I3	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR 56	10	0.1	21/06/2024

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:

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

$$\text{Factor de Ajuste} = ((63,00 \text{ euros} - 0,596 \text{ euros}) - 1,00 \text{ euro}) / (63,00 \text{ euros} - 0,596 \text{ euros}) = \mathbf{0.98397539}$$

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 28/05/24 (incluido):

	SIBE	ISIN	Producto	Call/Put	Subyacente	Precio de Ejercicio		Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	K7312	NLBNPES18U88	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR	55.1000	9.8398	0.1016	21/06/2024
2	K7313	NLBNPES1N2U1	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR	55.1000	9.8398	0.1016	20/09/2024
3	K7314	NLBNPES1LBC7	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR	57.0700	9.8398	0.1016	20/09/2024
4	K5699	NLBNPES19MR3	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR	59.0400	9.8398	0.1016	21/06/2024
5	K5700	NLBNPES1A9S5	WARRANT	CALL	Viscofan SA	EUR	63.9600	9.8398	0.1016	21/06/2024
6	K7317	NLBNPES1MGZ5	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR	45.2600	9.8398	0.1016	21/06/2024
7	K7318	NLBNPES1N6D8	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR	47.2300	9.8398	0.1016	21/06/2024
8	K7319	NLBNPES1JEX1	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR	47.2300	9.8398	0.1016	20/09/2024
9	K7320	NLBNPES1PL01	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR	49.2000	9.8398	0.1016	20/09/2024
10	K5705	NLBNPES1HRO6	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR	51.1700	9.8398	0.1016	21/06/2024
11	K5706	NLBNPES1Z6I3	WARRANT	PUT	Viscofan SA	EUR	55.1000	9.8398	0.1016	21/06/2024

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

En Madrid a 27 de Mayo de 2024