



COMUNICADO 21/17

Fecha: 8 de junio de 2017

Asunto: BANCO POPULAR ESPAÑOL S.A. – Ajustes a los contratos de Futuro y Opción

Como continuación al Comunicado 20/17, MEFF comunica que la decisión tomada en el día de hoy por la Comisión de Supervisión y Vigilancia en relación al Hecho Corporativo sucedido sobre BANCO POPULAR ESPAÑOL S.A. ha sido:

Liquidar anticipadamente a precio teórico la posición abierta en contratos de derivados sobre BANCO POPULAR ESPAÑOL S.A., el 9 de junio de 2017. La liquidación se hará efectiva con fecha valor 12 de junio de 2017.

Los parámetros utilizados en el cálculo del precio teórico serán:

- El precio de subyacente será de cero euros.
- Los dividendos esperados serán cero.
- Dado que el precio del subyacente ha quedado fijado en cero no solo para el momento presente, sino también para cualquier momento futuro, la volatilidad utilizada para el cálculo del precio teórico de las opciones será de cero.

Dado que las acciones subyacentes de los contratos de derivados sobre BANCO POPULAR ESPAÑOL S.A. han sido amortizadas y por lo tanto no existen, todos los contratos de derivados sobre BANCO POPULAR ESPAÑOL, S.A. serán liquidados por diferencias, independientemente de que su método de liquidación original hubiese sido definido como por entrega o por diferencias.