

COMUNICADO 07/22

Fecha: 16 de marzo de 2022

Asunto: MEDIASET ESPAÑA COMUNICACIÓN, S.A. (TL5) – Ajuste a los contratos de Futuro y Opción

MFE-MEIDAFOREUROPE N.V., (Oferente en adelante), comunicó a la CNMV mediante Información Privilegiada, con fecha 15 de marzo, el anuncio previo de la Solicitud de autorización relativo a la Oferta Pública Voluntaria de adquisición de acciones de MEDIASET ESPAÑA COMUNICACIÓN, S.A. (MEDIASET en adelante).

El anuncio señala que dentro del mes siguiente a la fecha de su publicación el Oferente, presentará ante la CNMV la solicitud de autorización de la Oferta. La Oferta se realizará sobre el 44,31% del capital social de MEDIASET. La contraprestación ofrecida por el Oferente es de 1,86 euros en efectivo y 4,5 acciones Ordinarias A del Oferente por cada acción de MEDIASET.

La Oferta está condicionada a la aceptación de al menos el 90% de las acciones objetivo, es decir, el 39,88% del capital social y de la aprobación por parte de la Junta General del Oferente.

MEFF informa que a cierre de la presente sesión cerrará a negociación todos los vencimientos de contratos de derivados sobre MEDIASET que no tengan posición abierta y no se abrirán nuevos vencimientos hasta que finalice la OPA.

Tal y como se establece en los apartados 4.7.8 y 5.7.8 de las Condiciones Generales para el Segmento de Derivados Financieros, MEFF convocará, una vez publicado el Folleto correspondiente, a la Comisión de Supervisión y Vigilancia para determinar qué resultado de la OPA se deberá cumplir para ajustar los Contratos de Futuro y Opción. En el supuesto de realizar la liquidación de la posición abierta a precio teórico, se utilizarán los parámetros que figuran en el Anexo 1 de este Comunicado.

Para más información, puede contactar con meffmarketservices@grupobme.es

Anexo 1

Precio de activo subyacente: se utilizará el precio de la OPA.

Dividendos esperados a 11 de marzo de 2022

Exdate	Cuantía/Amount
27-abr-22	0.3100

Call ATM Volatility						
Vencimiento	07/03/2022	08/03/2022	09/03/2022	10/03/2022	11/03/2022	Media
14/04/2022	46.3%	49.8%	52.9%	56.2%	55.1%	52.0%
20/05/2022	40.3%	43.1%	44.8%	47.1%	47.0%	44.5%
17/06/2022	42.3%	45.1%	47.2%	48.2%	47.8%	46.1%
16/09/2022	48.2%	49.7%	48.4%	49.1%	48.4%	48.8%
16/12/2022	47.2%	47.7%	47.0%	46.7%	46.3%	47.0%

Put ATM Volatility						
Vencimiento	07/03/2022	08/03/2022	09/03/2022	10/03/2022	11/03/2022	Media
14/04/2022	25.8%	29.2%	33.0%	36.4%	37.1%	32.3%
20/05/2022	21.7%	24.1%	25.6%	28.4%	29.9%	25.9%
17/06/2022	21.3%	23.5%	24.9%	26.5%	28.1%	24.8%
16/09/2022	26.6%	27.5%	27.1%	28.6%	29.6%	27.9%
16/12/2022	28.4%	28.7%	28.8%	29.2%	30.0%	29.0%

Skew+						
Vencimiento	07/03/2022	08/03/2022	09/03/2022	10/03/2022	11/03/2022	Media
14/04/2022	0.11%	0.07%	0.12%	0.07%	0.00%	0.08%
20/05/2022	0.11%	0.07%	0.11%	0.07%	0.00%	0.07%
17/06/2022	0.10%	0.07%	0.10%	0.07%	0.01%	0.07%
16/09/2022	0.08%	0.06%	0.08%	0.06%	0.02%	0.06%
16/12/2022	0.07%	0.05%	0.07%	0.05%	0.03%	0.05%

Skew-						
Vencimiento	07/03/2022	08/03/2022	09/03/2022	10/03/2022	11/03/2022	Media
14/04/2022	0.12%	0.09%	0.14%	0.09%	0.00%	0.09%
20/05/2022	0.12%	0.09%	0.13%	0.09%	0.01%	0.09%
17/06/2022	0.12%	0.09%	0.12%	0.09%	0.03%	0.09%
16/09/2022	0.10%	0.08%	0.10%	0.08%	0.04%	0.08%
16/12/2022	0.07%	0.06%	0.07%	0.06%	0.02%	0.05%

Precio ATM considerado: promedio del precio de cierre del 7 al 11 de marzo: 4,6146€