

COMUNICADO 01/23

Fecha: 1 de febrero de 2023

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

MFE-MEDIAFOREUROPE N.V., (MFE en adelante) y MEDIASET ESPAÑA COMUNICACIÓN, S.A. (MES en adelante) comunicaron a la CNMV mediante Información Privilegiada, con fecha 30 de enero, la propuesta de fusión transfronteriza por absorción de MEDIASET ESPAÑA COMUNICACIÓN, S.A (sociedad absorbida en adelante MES) por parte de MFE-MEDIAFOREUROPE. S.A (sociedad absorbente en adelante MFE).

El anuncio señala que está previsto que las Juntas Generales Extraordinarias de MFE y MES para aprobar la Fusión sean en marzo de 2023. La ecuación de canje acordada asciende a 7 acciones A de MFE de nueva emisión, por cada acción de MES. Los accionistas de MES que voten en contra de la Fusión en la Junta General Extraordinaria tendrán derecho a ejercitar sus derechos de separación. El precio de reembolso pagadero a los Accionistas que se separan será de 3,2687 euros por acción.

Está previsto que la Fusión sea efectiva durante el segundo trimestre de 2023.

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.

Tal y como se establece en los apartados 4.7.12 y 5.7.12 de las Condiciones Generales para el Segmento de Derivados Financieros, MEFF convocará a la Comisión de Supervisión y Vigilancia para determinar los escenarios en los que se ajustarán 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: el precio de reembolso a los accionistas que se separan 3.2687€

Dividendos esperados

Exdate	Cuantía
28-abr-23	0.3200

Call ATM Volatility						
Vencimiento	24/01/2023	25/01/2023	26/01/2023	27/01/2023	30/01/2023	Media
17/03/2023	44.30%	44.30%	44.20%	44.20%	44.60%	44.32%
16/06/2023	42.60%	42.60%	42.60%	42.60%	42.70%	42.62%
15/09/2023	42.30%	42.30%	42.30%	42.30%	42.30%	42.30%
15/12/2023	40.80%	40.80%	40.80%	40.70%	40.80%	40.78%

Put ATM Volatility						
Vencimiento	24/01/2023	25/01/2023	26/01/2023	27/01/2023	30/01/2023	Media
17/03/2023	34.50%	34.50%	34.50%	34.50%	34.50%	34.50%
16/06/2023	32.80%	32.80%	32.80%	32.70%	32.70%	32.76%
15/09/2023	37.10%	37.10%	37.10%	37.10%	37.20%	37.12%
15/12/2023	37.00%	37.00%	37.00%	37.00%	37.10%	37.02%

Skew+						
Vencimiento	24/01/2023	25/01/2023	26/01/2023	27/01/2023	30/01/2023	Media
17/03/2023	-0.37%	-0.38%	-0.33%	-0.28%	-0.33%	-0.34%
16/06/2023	-0.44%	-0.41%	-0.44%	-0.47%	-0.50%	-0.45%
15/09/2023	-0.24%	-0.22%	-0.24%	-0.26%	-0.28%	-0.25%
15/12/2023	-0.08%	-0.07%	-0.08%	-0.09%	-0.10%	-0.08%

Skew-						
Vencimiento	24/01/2023	25/01/2023	26/01/2023	27/01/2023	30/01/2023	Media
17/03/2023	-1.31%	-1.26%	-1.31%	-1.36%	-1.41%	-1.33%
16/06/2023	-1.08%	-1.05%	-1.08%	-1.11%	-1.14%	-1.09%
15/09/2023	-0.99%	-0.97%	-0.99%	-1.01%	-1.03%	-1.00%
15/12/2023	-0.84%	-0.82%	-0.84%	-0.86%	-0.88%	-0.85%

Precio ATM considerado: promedio del precio de cierre del 24 al 30 de enero: 3.3148€