

**COMUNICADO 22/20**

Fecha: 1 de septiembre de 2020

Asunto: BME, S.A. - Ajustes a los Contratos de Futuro y Opción

Comunicados relacionados: 05/20, 06/20 y 13/20

SIX GROUP AG (SIX en adelante) ha anunciado, mediante hecho relevante a la CNMV, que a 31 de Agosto de 2020, el número de acciones adquiridas de BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SOCIEDAD HOLDING DE MERCADOS Y SISTEMAS FINANCIEROS S.A. (BME en adelante) por SIX en la Oferta Pública de Adquisición que realizó sumadas a las que habían ejercitado su derecho de compra forzosa, ascendía a un total de 79.698.520, representativas de aproximadamente el 95,315% de su capital social. Por lo tanto, se ha dado cumplimiento a todos los requisitos previstos en su Oferta Pública de Adquisición para que SIX pueda ejercitar el derecho de venta forzosa.

SIX notificará a la CNMV, antes del próximo 5 de septiembre su decisión de ejercitar el derecho de venta forzosa, así como la fecha de la operación de dicha venta forzosa y el resto de los detalles necesarios para su ejercicio.

La liquidación de la operación de venta forzosa conllevará que las acciones de BME queden excluidas de cotización de las Bolsas de Valores de Madrid, Barcelona, Bilbao y Valencia. Los Contratos de Futuro y Opción sobre BME serán liquidados a valor teórico, tal y como está previsto en los apartados 4.7.8 y 5.7.8 de las Condiciones Generales.

A partir de mañana, MEFF cerrará a negociación y registro todos los contratos con subyacente BME que pertenezcan a vencimientos donde no exista posición abierta, y no abrirá nuevos vencimientos.

Las volatilidades y dividendos que se usarían para el cálculo del valor teórico, serían las recogidas en el anexo de esta comunicado, con arreglo a lo previsto en el Anexo 1 de las Condiciones Generales de futuros y de opciones sobre acciones.

**NOTICE 22/20**

Date: 1 September 2020

Subject: BME, S.A. – Adjustment to Futures and Options Contracts

Related Notice: 05/20, 06/20 and 13/20

SIX GROUP AG (SIX hereon) has announced, through a relevant fact to the CNMV, that as of 31 August 2020, the total number of shares acquired of BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SOCIEDAD HOLDING DE MERCADOS Y SISTEMAS FINANCIEROS S.A. (BME hereon) as a result of the Voluntary Tender Offer plus the shares which exercised the sell-out right amounted to 79,698,520, representing in aggregate approximately 95.315% of the share capital. Therefore, all the requirements to exercise the squeeze-out right have been fulfilled.

SIX will notify the CNMV before the 5 September, its decision to exercise the squeeze-out right, as well as the date of the transaction resulting from such compulsory sale and other details necessary to exercise its right.

The squeeze-out transaction will imply the delisting of the BME shares from the Madrid, Barcelona, Bilbao and Valencia stock exchanges. Future and Option Contracts on BME will be settled at their fair value, according to the criteria established by sections 4.7.8 and 5.7.8 of the General Conditions.

Starting tomorrow, MEFF will close to trading and clearing all the contracts with BME as underlying that belong to maturities where there is no open position, and will not open new maturities.

Volatilities and dividends to be used in the fair valuation are specified in the annex to this notice, according to the specifications established in Annex 1 of the Futures and Option Contracts General Conditions.

## Anexo / Annex

- Precio de activo subyacente: se utilizará el precio de la operación de venta forzosa, ajustado por dividendos si los hubiera / Underlying price: the squeeze-out transaction price will be used, adjusted by dividends if there were any: 32,98 EUR.
- Dividendos esperados / Expected dividends:

Fecha Ex-date	Cuantía Amount
10.Sep.2020	0,40
28.Dec.2020	0,60

- Precio At The Money / At the Money Price: 25,048 EUR.
- Volatilidades y skews / Volatilities and skews:

Vencimiento Expiry	Call ATM	Put ATM	Skew +	Skew -
2020.09	22,09%	20,51%	0,61%	0,12%
2021.03	18,26%	17,07%	0,57%	0,04%