

COMUNICADO 23/20

Fecha: 4 de septiembre de 2020

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

Comunicados relacionados: 05/20, 06/20, 13/20 y 22/20.

SIX GROUP AG (SIX en adelante) anunció ayer 3 de septiembre, mediante el registro oficial de *Otra información* relevante de CNMV, que el día 24 de septiembre de 2020 es la fecha de la operación de venta forzosa sobre las acciones de BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SOCIEDAD HOLDING DE MERCADOS Y SISTEMAS FINANCIEROS S.A. (BME en adelante).

SIX solicitará a la CNMV suspender con efectos el día 14 de septiembre de 2020, tras el cierre del mercado bursátil, la negociación de las acciones de BME.

Si la solicitud resultara aprobada, los Contratos de Futuro y Opción sobre BME serán liquidados al cierre de la sesión del día 14 de septiembre, a valor teórico, tal y como está previsto en los apartados 4.7.8 y 5.7.8 de las Condiciones Generales.

Las volatilidades y dividendos que se usarán para el cálculo del valor teórico, serán las recogidas en el anexo de este comunicado.

NOTICE 23/20

Date: 4 September 2020

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

Related Notice: 05/20, 06/20, 13/20 and 22/20.

SIX GROUP AG (SIX hereon) announced yesterday, September 3, through a relevant fact to the CNMV, that 14 September 2020 is set as the date of the squeeze-out transaction on BOLSAS Y MERCADOS ESPAÑOLES, SOCIEDAD HOLDING DE MERCADOS Y SISTEMAS FINANCIEROS S.A. (BME hereon).

SIX will request the CNMV to suspend, with effects 14 September 2020, after the closing of the stock market, the trading of BME shares.

If the request is approved, Future and Option Contracts on BME will be settled at the close of the session on September 14, at their fair value, according to the criteria established by sections 4.7.8 and 5.7.8 of the General Conditions.

Volatilities and dividends to be used in the fair value are specified in the annex to this notice.

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%