

COMUNICADO 12/22

Fecha: 18 de mayo de 2022

Asunto: SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY S.A. – Ajuste a los contratos de Futuro y Opción

SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY S.A. (SIEMENS GAMESA), ha informado a la CNMV mediante Hecho Relevante con fecha 18 de mayo, que el equipo gestor de Siemens Energy AG está considerando una oferta pública de adquisición en efectivo sobre la totalidad de las acciones de SIEMENS GAMESA con la intención de excluir a la sociedad de cotización. El resultado de dicho análisis sigue abierto. No se ha tomado ninguna decisión y no hay certeza de que la operación se materialice.

MEFF informa que a cierre de la presente sesión cerrará a negociación todos los vencimientos de contratos de derivados sobre SIEMENS GAMESA, 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 18 de mayo de 2022

Exdate	Cuantía/Amount
04-abr-24	0.0400

Precio ATM considerado: promedio del precio de cierre del 11 al 17 de mayo: 13,434 €

Call ATM Volatilidad											
	20/05/2022	17/06/2022	15/07/2022	16/09/2022	16/12/2022	17/03/2023	16/06/2023	15/09/2023	15/12/2023	15/03/2024	20/12/2024
17/05/2022	51.2%	43.3%	41.1%	44.3%	43.9%	41.8%	40.8%	40.1%	39.4%	38.8%	38.3%
16/05/2022	55.1%	46.3%	43.4%	45.4%	45.0%	42.7%	41.5%	40.6%	39.9%	39.3%	38.7%
13/05/2022	54.3%	46.8%	46.0%	46.2%	45.4%	43.2%	42.0%	41.0%	40.2%	39.6%	39.0%
12/05/2022	53.7%	48.3%	47.6%	47.0%	45.8%	43.6%	42.2%	41.2%	40.4%	39.7%	39.1%
11/05/2022	53.9%	49.3%	48.6%	47.9%	46.7%	44.3%	42.8%	41.7%	40.8%	40.1%	39.4%
Media	53.6%	46.8%	45.3%	46.2%	45.4%	43.1%	41.9%	40.9%	40.2%	39.5%	38.9%

Put ATM Volatilidad											
	20/05/2022	17/06/2022	15/07/2022	16/09/2022	16/12/2022	17/03/2023	16/06/2023	15/09/2023	15/12/2023	15/03/2024	20/12/2024
17/05/2022	49.6%	43.3%	42.5%	43.3%	42.5%	40.5%	39.9%	39.3%	38.8%	38.4%	37.9%
16/05/2022	53.3%	46.6%	46.2%	45.7%	45.0%	42.9%	41.8%	40.9%	40.2%	39.5%	38.9%
13/05/2022	54.0%	47.0%	46.5%	47.2%	45.9%	43.7%	42.5%	41.5%	40.7%	40.0%	39.3%
12/05/2022	53.4%	48.5%	48.2%	48.1%	46.4%	44.1%	42.8%	41.7%	40.9%	40.2%	39.5%
11/05/2022	53.6%	49.5%	49.1%	48.9%	47.2%	44.8%	43.3%	42.2%	41.3%	40.5%	39.8%
Media	52.8%	47.0%	46.5%	46.6%	45.4%	43.2%	42.0%	41.1%	40.4%	39.7%	39.1%

Skew +											
	20/05/2022	17/06/2022	15/07/2022	16/09/2022	16/12/2022	17/03/2023	16/06/2023	15/09/2023	15/12/2023	15/03/2024	20/12/2024
17/05/2022	0.77%	0.70%	0.56%	0.45%	0.39%	0.39%	0.31%	0.25%	0.21%	0.18%	0.16%
16/05/2022	0.74%	0.65%	0.52%	0.42%	0.37%	0.37%	0.30%	0.24%	0.20%	0.18%	0.15%
13/05/2022	0.70%	0.60%	0.48%	0.39%	0.35%	0.35%	0.28%	0.24%	0.20%	0.18%	0.15%
12/05/2022	0.65%	0.55%	0.44%	0.36%	0.33%	0.33%	0.26%	0.22%	0.19%	0.16%	0.14%
11/05/2022	0.60%	0.50%	0.40%	0.33%	0.31%	0.31%	0.24%	0.20%	0.17%	0.14%	0.13%
Media	0.69%	0.60%	0.48%	0.39%	0.35%	0.35%	0.28%	0.23%	0.19%	0.17%	0.15%

Skew -											
	20/05/2022	17/06/2022	15/07/2022	16/09/2022	16/12/2022	17/03/2023	16/06/2023	15/09/2023	15/12/2023	15/03/2024	20/12/2024
17/05/2022	0.39%	0.33%	0.23%	0.17%	0.16%	0.17%	0.15%	0.13%	0.11%	0.09%	0.08%
16/05/2022	0.37%	0.30%	0.21%	0.15%	0.15%	0.16%	0.14%	0.12%	0.10%	0.09%	0.07%
13/05/2022	0.33%	0.25%	0.18%	0.14%	0.14%	0.15%	0.13%	0.11%	0.10%	0.08%	0.07%
12/05/2022	0.28%	0.24%	0.18%	0.13%	0.14%	0.14%	0.12%	0.10%	0.09%	0.07%	0.06%
11/05/2022	0.23%	0.26%	0.22%	0.16%	0.16%	0.13%	0.11%	0.09%	0.08%	0.07%	0.07%
Media	0.32%	0.28%	0.20%	0.15%	0.15%	0.15%	0.13%	0.11%	0.10%	0.08%	0.07%