

**COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES**

Dirección General de Mercados  
Paseo de la Castellana, 15  
28046 Madrid

**COMUNICACIÓN DE HECHO RELEVANTE**



**BNP PARIBAS**

**NOTIFICA**

**EVENTO EXTRAORDINARIO**

Merlin Properties Socimi SA realizará la entrega de un pago especial.

Nombre Compañía: Merlin Properties Socimi SA  
Reuters: MRL.MC  
Bloomberg: MRL:SQ  
ISIN: ES0105025003

Fecha de Registro: 03/08/22  
Fecha ExDate: 04/08/22  
Pago Especial: 0.750 EUR por acción  
Precio de Cierre de Merlin Properties Socimi SA en la Fecha de Registro (03/08/22): 10.44 EUR

**EMISIONES AFECTADAS**

Este evento extraordinario afectará a los siguientes instrumentos emitidos por BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V.:

	SIBE	ISIN	Producto	Call/Put	Subyacente	Precio de Ejercicio	Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	J5412	NLBNPES15JR7	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 8.5	2	0.5	16/09/2022
2	J5408	NLBNPES15JN6	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 9.5	2	0.5	16/09/2022
3	J6679	NLBNPES163G3	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 9.5	2	0.5	16/09/2022
4	J6680	NLBNPES163H1	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 10	2	0.5	16/09/2022
5	J6681	NLBNPES163I9	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 10	2	0.5	16/12/2022
6	J6676	NLBNPES163D0	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 11	2	0.5	16/09/2022
7	J6677	NLBNPES163E8	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 11	2	0.5	16/12/2022
8	J6678	NLBNPES163F5	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 11.5	2	0.5	16/09/2022

**AJUSTE**

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. aplicará el siguiente Factor de Ajuste sobre las características de las emisiones anteriores para que este evento extraordinario tenga un efecto económicamente neutral:

$$\text{Factor de Ajuste} = 1 - \frac{\text{Dividendo Extraordinario}}{\text{Precio de Cierre en la Fecha de Registro}}$$

$$\text{Factor de Ajuste} = 1 - (0.75 \text{ euros} / 10.4400 \text{ euros}) = \mathbf{0.92816092}$$

Nuevo Precio de Ejercicio (redondeado a 2 decimales) = Viejo Precio de Ejercicio x Factor de Ajuste

Nueva Paridad (redondeada a 4 decimales) = Vieja Paridad x Factor de Ajuste

Nuevo Ratio (redondeado a 4 decimales) = 1 / Nueva Paridad

<b>NUEVAS CARACTERÍSTICAS DE LAS EMISIONES AFECTADAS</b>
--

Una vez aplicado el ajuste anterior sobre las características de las citadas emisiones, éstas tendrán las siguientes características a partir del 04/08/22 (incluido):

	SIBE	ISIN	Producto	Call/Put	Subyacente	Nuevo Precio de Ejercicio	Nueva Paridad	Nuevo Ratio	Fecha de Vencimiento
1	J5412	NLBNPES15JR7	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 7.89	1.8563	0.5387	16/09/2022
2	J5408	NLBNPES15JN6	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 8.82	1.8563	0.5387	16/09/2022
3	J6679	NLBNPES163G3	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 8.82	1.8563	0.5387	16/09/2022
4	J6680	NLBNPES163H1	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 9.28	1.8563	0.5387	16/09/2022
5	J6681	NLBNPES163I9	WARRANT	PUT	Merlin Properties Socimi	EUR 9.28	1.8563	0.5387	16/12/2022
6	J6676	NLBNPES163D0	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 10.21	1.8563	0.5387	16/09/2022
7	J6677	NLBNPES163E8	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 10.21	1.8563	0.5387	16/12/2022
8	J6678	NLBNPES163F5	WARRANT	CALL	Merlin Properties Socimi	EUR 10.67	1.8563	0.5387	16/09/2022

BNP Paribas Arbitrage Issuance B.V. comunica lo anterior para conocimiento del público en general a los efectos oportunos.

En Madrid a 3 de Agosto de 2022