

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

Deutsche Lufthansa AG inicia un proceso de Ampliación de Capital con las siguientes características:

Nombre Compañía:	Deutsche Lufthansa AG
Reuters:	HAG.DE
Bloomberg:	LHA GY
ISIN:	DE0008232125

Términos: 1 X 1 (= 1 acción nueva por cada acción vieja)

Precio Suscripción: 3.58 EUR

Período de Suscripción: [22/09/21, 30/09/21]

Fecha de Registro: 21/09/2021

Precio de Cierre de Deutsche Lufthansa AG en la Fecha de Registro (21/09/21): 8.377 EUR

EMISIONES AFECTADAS

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

	SIBE	ISIN	Producto	Tipo	Subyacente	Precio de Ejercicio		Barrera	Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	J1884	NLBNPES13KS8	WARRANT	PUT	LHAG.DE	EUR	10		10	0.1	18/03/2022
2	J1883	NLBNPES13KR0	WARRANT	CALL	LHAG.DE	EUR	12		10	0.1	18/03/2022
3	J1130	NLBNPES13BJ6	WARRANT	CALL	LHAG.DE	EUR	12.5		10	0.1	17/12/2021
4	J1131	NLBNPES13BK4	WARRANT	PUT	LHAG.DE	EUR	10.5		10	0.1	17/12/2021
5	J2135	NLBNPES13T11	WARRANT	CALL	LHAG.DE	EUR	10		10	0.1	17/12/2021
6	J2136	NLBNPES13T29	WARRANT	PUT	LHAG.DE	EUR	9		10	0.1	17/12/2021

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:

$$\begin{aligned} \text{Factor de Ajuste} &= \left[\frac{AV}{AV + AN} \times \left(1 - \left(\frac{PS}{PC} \right) \right) \right] + \left(\frac{PS}{PC} \right) = \\ &= \left[\frac{1}{1 + 1} \times \left(1 - \left(\frac{3.58 \text{ EUR}}{8.377 \text{ EUR}} \right) \right) \right] + \left(\frac{3.58 \text{ EUR}}{8.377 \text{ EUR}} \right) = \\ &= 0.71368032 \end{aligned}$$

Dónde:

AN = Acciones Nuevas

AV = Acciones Viejas

PS = Precio de Suscripción

PC = Precio de Cierre en la Fecha de Registro

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 3 decimales) = 1 / Nueva Paridad

NUEVAS CARACTERÍSTICAS DE LAS EMISIONES AFECTADAS
--

Una vez aplicado el ajuste anterior sobre las características de las citadas emisiones, éstas tendrán las siguientes características a partir del 22/09/2021 (incluido):

	SIBE	ISIN	Producto	Tipo	Subyacente	Precio de Ejercicio		Barrera	Paridad	Ratio	Fecha de Vencimiento
1	J1884	NLBNPES13KS8	WARRANT	PUT	LHAG.DE	EUR	7,14		7,1368	0,140	18/03/2022
2	J1883	NLBNPES13KR0	WARRANT	CALL	LHAG.DE	EUR	8,56		7,1368	0,1401	18/03/2022
3	J1130	NLBNPES13BJ6	WARRANT	CALL	LHAG.DE	EUR	8,92		7,1368	0,140	17/12/2021
4	J1131	NLBNPES13BK4	WARRANT	PUT	LHAG.DE	EUR	7,49		7,1368	0,1401	17/12/2021
5	J2135	NLBNPES13T11	WARRANT	CALL	LHAG.DE	EUR	7,14		7,1368	0,140	17/12/2021
6	J2136	NLBNPES13T29	WARRANT	PUT	LHAG.DE	EUR	6,42		7,1368	0,1401	17/12/2021

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

En París a 21 de Septiembre de 2021