

**ANEXO 1 A LA ORDEN DE SUSCRIPCIÓN PARA LA ADQUISICIÓN DE LA
NOTA ESTRUCTURADA SOBRE CESTA DE ACCIONES CREDIT SUISSE SERIE
SPLB2010-1127 VTO. 2013 (ISIN XS0517955554)¹.**

**FÓRMULAS PARA EL CÁLCULO DE LOS CUPONES Y DEL IMPORTE A
REEMBOLSAR EN LA FECHA DE VENCIMIENTO.**

1. Pago de Cupones.

En cada Fecha de Pago de Cupón el Titular recibirá un Cupón por cada Nota calculado de la siguiente manera:

$$\text{Importe Nominal} * 9\% * \text{Base Liquidación (Actual/Actual)}$$

A estos efectos:

Base Liquidación (Actual/Actual): el número de días en el Periodo de Cálculo correspondiente dividido entre 365. Si una parte del Periodo de Cálculo cae en un año bisiesto, entonces será la suma de (a) el número de días de la parte del Periodo de Cálculo que cae en el año bisiesto dividido entre 366 más (b) el número de días de la parte del Periodo de Cálculo que cae en el año no bisiesto dividido entre 365.

Periodos de Cálculo: en relación con una Fecha de Pago de Cupón, cada periodo comprendido entre la Fecha de Pago de Cupón inmediatamente anterior (incluida) y esa Fecha de Pago de Cupón (excluida), a excepción del Periodo de Cálculo para la primera Fecha de Pago de Cupón, que comenzará en la Fecha de Emisión (incluida) y terminará en dicha primera Fecha de Pago del Cupón (excluida).

2. Importe a reembolsar en la Fecha de Vencimiento.

En caso de que las Notas no se hayan cancelado anticipadamente, éstas vencerán en la Fecha de Vencimiento y se abonará a los Titulares el siguiente importe por cada Nota:

- El 100% del Importe Nominal de la Nota, si se cumple la siguiente condición

$$\underset{i \rightarrow 1}{\overset{i=3}{MIN}} \left(\frac{Share_{i,3}}{Share_{i,0}} \right) \geq 0,75$$

- El 100% del Importe Nominal de la Nota, si no se cumple lo anterior, pero se cumple que

¹ Los términos que en el presente Anexo se emplean en mayúsculas tendrán el significado que se les da en la Orden de Suscripción, salvo que en este Anexo se establezca otra cosa.

$$\underset{i \rightarrow 1}{\overset{i=3}{\text{MIN}}}\left(\frac{\text{Share}_{i,1}}{\text{Share}_{i,0}}\right) \geq 1 \quad \text{ó} \quad \underset{i \rightarrow 1}{\overset{i=3}{\text{MIN}}}\left(\frac{\text{Share}_{i,2}}{\text{Share}_{i,0}}\right) \geq 1$$

- En caso de que no se cumpla ninguna de las condiciones anteriores, el importe resultante de la siguiente fórmula

$$\text{Importe Nominal} * \underset{i \rightarrow 1}{\overset{i=3}{\text{MIN}}}\left(\frac{\text{Share}_{i,3}}{\text{Share}_{i,0}}\right)$$

A estos efectos:

Share_{i,0}: precio oficial de cierre de la Acción i publicado por el Mercado correspondiente el 11 de junio de 2010.

Share_{i,1}: precio oficial de cierre de la Acción i publicado por el Mercado correspondiente el 13 de junio de 2011.

Share_{i,2}: precio oficial de cierre de la Acción i publicado por el Mercado correspondiente el 11 de junio de 2012.

Share_{i,3}: precio oficial de cierre de la Acción i publicado por el Mercado correspondiente el 11 de junio de 2013.

Acciones:

i	Acción
1	Johnson & Johnson
2	Intel Corporation
3	Apple Inc.