

ANEXO 1 A LA ORDEN DE SUSCRIPCIÓN PARA LA ADQUISICIÓN DEL BONO ESTRUCTURADO SOBRE ÍNDICE DOURO SERIE 2017-406 VTO. 2022 (ISIN XS1579414969)¹

1 Importe a reembolsar en la Fecha de Vencimiento.

En caso de que los Bonos no se hayan amortizado anticipadamente, como consecuencia de un supuesto extraordinario de cancelación anticipada se amortizarán en la Fecha de Vencimiento y se abonará al Titular/es el siguiente importe por cada Bono:

- a) Si y sólo si se cumple la siguiente condición

$$\left(\frac{Index_f}{Index_0} \right) \geq 100\%$$

El importe resultante de la siguiente fórmula

$$\text{Importe Nominal X} \left[1 + \left(0.50 \times \frac{Index_f - Index_0}{Index_0} \right) \right]$$

Esta fórmula implica que, si se cumple la condición, el Titular(es) recibirá(n) el importe nominal del Bono incrementado en el 50% de la revalorización del Índice.

- b) En caso de que se cumpla la condición

$$\left(\frac{Index_f}{Index_0} \right) < 100\%$$

El importe resultante de la siguiente fórmula:

$$\text{Importe Nominal X Max} \left[0,90; \left(\frac{Index_f}{Index_0} \right) \right]$$

Esta fórmula implica que, si se cumple la condición, el Titular(es) recibirá(n) el Importe Nominal del Bono reducido en la depreciación que haya sufrido el Índice hasta un máximo del 10%. En otras palabras, en el peor de los escenarios el Titular(es) recibirá(n) el 90% del Importe Nominal del Bono.

Determinación del valor del Índice Subyacente de Referencia.

Index_f: el valor del Índice EURO STOXX 50 Index publicado por el mercado en fecha 21 marzo 2022.

Index₀: el valor del Índice EURO STOXX 50 Index publicado por el mercado en fecha 8 marzo 2017.

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.