

ANEXO 1 A LA ORDEN DE SUSCRIPCIÓN PARA LA ADQUISICIÓN DEL BONO ESTRUCTURADO SOBRE ÍNDICE DOURO SERIE 2017-413 VTO. 2020 (ISIN XS1587234094)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

$$\text{Importe Nominal X} \left[1 + \text{Min} \left(0.25 \times \frac{Index_f - Index_0}{Index_0} \right) \right]$$

Esta fórmula implica que, si se cumple la condición, el Titular(es) recibirá(n) el importe nominal del Bono incrementado en la revalorización del índice limitado a un máximo de un 25% de la revalorización del Índice.

- b) En caso de que se cumpla la condición

$$100\% > \left(\frac{Index_f}{Index_0} \right) \geq 75\%$$

El importe resultante de la siguiente fórmula:

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

Esta fórmula implica que, si se cumple la condición, el Titular(es) recibirá(n) el Importe Nominal del Bono incrementado en la depreciación que haya sufrido el Índice

- c) En caso de que se cumpla la condición:

$$75\% > \left(\frac{Index_f}{Index_0} \right)$$

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.

El importe resultante de la siguiente fórmula:

$$\text{Importe nominal X} \left(\frac{\text{Index}_f}{\text{Index}_0} \right)$$

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.

Determinación del valor del Índice Subyacente de Referencia.

Index_f: el valor del Índice EURO STOXX 50 Index publicado por el mercado en fecha 30 marzo 2020.

Index₀: el valor del Índice EURO STOXX 50 Index publicado por el mercado en fecha 21 marzo 2017.