



D. Àlex Valencia Baeza, actuando en nombre y representación de CaixaBank, S.A., domiciliada en Barcelona, Avenida Diagonal 621, provista de N.I.F. número A-08663619 e inscrita en el Registro Administrativo Especial del Banco de España con el número 2100 y en el Registro Mercantil de Barcelona, tomo 42.657, folio 33, hoja B-41232, inscripción 109ª, en relación con el **Suplemento al Folleto de Base de Valores No Participativos 2015 de Caixabank, S.A.**, inscrito por la Comisión Nacional del Mercado de Valores en fecha 28 de abril de 2016, por medio de la presente,

CERTIFICA

Que el contenido del SUPLEMENTO AL FOLLETO DE BASE DE VALORES NO PARTICIPATIVOS 2015 DE CAIXABANK, S.A. registrado en la CNMV en fecha 28 de abril de 2016, coincide exactamente con el soporte informático enviado telemáticamente y,

AUTORIZA

La publicación del SUPLEMENTO AL FOLLETO DE BASE DE VALORES NO PARTICIPATIVOS 2015 DE CAIXABANK, S.A. en la página Web de la Comisión Nacional del Mercado de Valores y,

Y, para que conste a los efectos oportunos, expido la presente en Barcelona, a 28 de abril de 2016

D. Àlex Valencia Baeza

SUPLEMENTO AL FOLLETO DE BASE DE VALORES NO PARTICIPATIVOS
JULIO 2015 DE CAIXABANK, S.A. INSCRITO EN LOS REGISTROS
OFICIALES DE LA COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES
EL 28 DE JULIO DE 2015

El presente suplemento (en adelante, el “Suplemento”) al Folleto de Base de Valores No Participativos Julio 2015 (en adelante, el “Folleto de Base”) de Caixabank, S.A. (en adelante “el Emisor”), inscrito en los registros oficiales de la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) en fecha 28 de julio de 2015, se ha elaborado de conformidad con lo establecido en el artículo 22 del Real Decreto 1310/2005, de 4 de noviembre, por el que se desarrolla parcialmente la Ley 24/1988, de 28 de julio, del Mercado de Valores, en materia de admisión a negociación de valores en mercados secundarios oficiales, de ofertas públicas de venta o suscripción y del folleto exigible a tales efectos.

El presente Suplemento deberá leerse conjuntamente con el Folleto de Base, con el suplemento al mismo inscrito en los registros oficiales de la CNMV en fecha 17 de marzo de 2016 y, en su caso, con cualquier otro suplemento a dicho Folleto de Base que Caixabank, S.A. pueda publicar en el futuro.

1. PERSONAS RESPONSABLES DE LA INFORMACIÓN

D. Àlex Valencia Baeza, Director de Àrea de Análisis y Seguimiento de Balance, actuando en virtud del acuerdo del Consejo de Administración de fecha 18 de junio de 2015 y en nombre y representación de Caixabank, S.A., asume la responsabilidad de la información contenida en este Suplemento.

D. Àlex Valencia Baeza asegura, tras comportarse con una diligencia razonable para garantizar que así es, que la información contenida en este Suplemento es, según su conocimiento, conforme a los hechos y no incurre en ninguna omisión que pudiera afectar a su contenido.

2. MODIFICACIÓN DEL ANEXO V (BONOS Y OBLIGACIONES ESTRUCTURADOS) DEL FOLLETO DE BASE

A los efectos de incorporar una nueva fórmula para el cálculo del precio de amortización a vencimiento, se modifica el apartado 4.1.12 del Anexo V (Bonos y Obligaciones Estructurados) del Folleto de Base, en su epígrafe B) “Amortización a vencimiento – Opción 3”, cuya redacción quedará como sigue:

“Opción 3:

En caso de que no se hubiera producido ningún Supuesto de Cancelación Anticipada y cuando el Precio Final del Subyacente fuera superior o igual a la Barrera de Capital (XX% de su Precio Inicial), el Producto sería amortizado en la Fecha de Vencimiento recibiendo el inversor el 100% del Importe Nominal de la Inversión.

En caso de que no se hubiera producido ningún Supuesto de Cancelación Anticipada y cuando el Precio Final del Subyacente fuera inferior a la Barrera de Capital (XX% de su Precio Inicial), el Producto sería amortizado en la Fecha

de Vencimiento, recibiendo el inversor un porcentaje del Importe Nominal de Inversión que se calculará según lo establecido en las siguientes fórmulas y dependiendo de si la pérdida de capital se produce a partir del Precio Inicial o de la Barrera de Capital:

A) Pérdida a partir del Precio Inicial (PI):

$$\text{Porcentaje IN} = \text{Max} \left[X\%; 1 - \left[f * \left(\frac{\text{PI} - \text{PF}}{\text{PI}} \right) \right] \right]$$

B) Pérdida a partir de la Barrera de Capital:

$$\text{Porcentaje IN} = \text{Max} \left[X\%; 1 - \left[f * \left(\frac{\text{Barrera de Capital} - \text{PF}}{\text{PI}} \right) \right] \right]$$

f = factor corrector por apalancamiento o desapalancamiento, siendo $f=0, \dots, n$

$X\%$ = porcentaje garantizado del nominal de la inversión. En todo caso inferior a 100%.

En caso de evolución desfavorable del subyacente, el inversor podría perder la totalidad de la inversión inicial incluso con un precio final del subyacente superior a 0, siempre que $X\%$ sea igual a 0%."

3. VIGENCIA DEL RESTO DE TÉRMINOS DEL FOLLETO DE BASE

Las modificaciones realizadas en el Folleto de Base en los epígrafes arriba mencionados de este Suplemento no conllevan la modificación de ningún otro término del Folleto de Base de Valores No Participativos Julio 2015 de Caixabank, S.A.

Desde el día 17 de marzo de 2016, fecha de inscripción en CNMV del suplemento al Folleto de Base en virtud del cual se incorporaron por referencia las cuentas anuales auditadas del ejercicio 2015, y hasta la fecha del presente Suplemento no se han producido otros hechos que afecten de manera significativa a la situación del Emisor, salvo los comunicados como "Hechos relevantes" a la CNMV.

Barcelona, a 27 de abril de 2016.

D. Alex Valencia Baeza
En representación del Emisor