



## **CONDICIONES FINALES**

### **EMISIÓN DE BONOS ESTRUCTURADOS FEBRERO I 2018**

**CAIXABANK, S.A.**

**50.000.000 EUROS**

**Emitida bajo el Folleto de Base de Valores no Participativos 2017, registrado en la Comisión Nacional de Mercado de Valores el 20 de julio de 2017.**

---

El Emisor declara que:

- a) Las Condiciones Finales se han elaborado a efectos de lo dispuesto en el artículo 5, apartado 4, de la Directiva 2003/71/CE y deben leerse en relación con el Folleto de Base<sup>1</sup> y el suplemento o suplementos<sup>2</sup> al mismo que pudieran publicarse.
- b) El Folleto de Base, está publicado en las páginas web del emisor ([www.caixabank.com](http://www.caixabank.com)) y de CNMV ([www.cnmv.es](http://www.cnmv.es)) de conformidad con lo dispuesto en el artículo 14 de la directiva 2003/71/CE.
- c) A fin de obtener la información completa, deberán leerse conjuntamente el Folleto de Base y las Condiciones Finales.

Los valores descritos en estas "Condiciones Finales" se emiten por CAIXABANK, S.A., con domicilio social en Valencia, C.P. 46002, calle Pintor Sorolla 2-4 y CIF A-08663619 (en adelante el "Emisor" o "CAIXABANK")

#### **1. DESCRIPCIÓN, CLASE Y CARACTERÍSTICAS DE LOS VALORES EMITIDOS**

**TÉRMINOS Y CONDICIONES ESPECÍFICOS DE LA EMISIÓN** (véanse los términos y condiciones generales del tipo de valor emitido en el Folleto de Base)

1. Naturaleza y denominación de los Valores
  - Emisión de Bonos Estructurados Febrero I 2018
  - Código ISIN: ES0240609141
  - Los valores integrantes de la presente emisión podrán tener la consideración de fungibles con otros de igual naturaleza que, con posterioridad, pudieran ser objeto de emisión.
2. Divisa de la Emisión: Euros
3. Importe de la Emisión:
  - Nominal: 50.000.000 Euros
  - Efectivo: 50.000.000 Euros
4. Importe unitarios de los valores:
  - Nominal unitario: 100.000 Euros
  - Número de valores: 500
  - Precio de la Emisión: 100%

---

<sup>1</sup> El Folleto de Base incorpora por referencia el Documento Registro de CAIXABANK, registrado en CNMV el 11 de julio de 2017.

<sup>2</sup> A la fecha de las presentes Condiciones Finales no existe ningún Suplemento al Folleto de Base de Valores no Participativos 2017.

- Efectivo Inicial: 100.000 Euros
5. Fecha de Emisión y Desembolso: 20 de febrero de 2018
  6. Fecha de Vencimiento: 20 de febrero de 2033
  7. Tipo de Interés Fijo: N/A
  8. Tipo de Interés variable: N/A
  9. **Tipo de interés indexado:** tipo de interés referenciado a un subyacente de modo que el tipo de interés es variable (cupones variables), de acuerdo con lo siguiente:

➤ **Cupones variables:** CMS 20 años (EUAMDB20 Index) - 0,086% pagaderos anualmente, de acuerdo con lo siguiente:

- **Nombre y descripción del Subyacente:** CMS 20 años (EUAMDB20 Index).

El índice de referencia CMS 20 años (EUAMDB20 Index) se define como el Constant Maturity Swap en Euros a plazo de 20 años, publicado en Bloomberg bajo el Ticker "EUAMDB20 Index" o cualquier otra página que pudiera sustituirla en un futuro (en adelante "Pantalla Relevante").

Si dicha página (o cualquiera que la sustituya en un futuro) no estuviera disponible, se tomará como "Pantalla Relevante" las páginas de información electrónica que ofrezcan los tipos CMS 20 años Euro de Reuters o cualquiera creada que sea práctica de mercado para reflejar el tipo *swap* a 20 años del Euro a las 11:00 horas.

En ausencia o imposibilidad de obtención del tipo establecido en los párrafos anteriores de este apartado, será de aplicación el último tipo de interés de referencia aplicado al último periodo de devengo de intereses en tanto en cuanto se mantenga esa situación.

- **Fórmula de cálculo:**

$$C = \frac{N * i * d}{36000}$$

Donde:

**C** es el cupón variable a pagar en cada periodo

**N** es el importe Nominal Unitario

**i** es el tipo de interés variable resultante de calcular CMS 20 años (EUAMDB20 Index) - 0,086%

**d** es igual a 360 días ajustado por la Convención Día Hábil. (Following Adjusted)

- **Fechas de determinación del tipo del interés variable aplicable a cada periodo:** El índice de referencia CMS 20 años (EUAMDB20 Index) para cada periodo anual se tomará dos días hábiles antes del inicio de dicho periodo sujeto a lo establecido sobre la Convención Día Hábil.

Cada periodo anual transcurre desde una Fecha de Pago de Cupón Variable (incluida) hasta la siguiente Fecha de Pago de Cupón Variable (excluida), teniendo en cuenta que el primer periodo anual comenzará en la Fecha Emisión y Desembolso (incluida) y el último periodo anual finalizará en la Fecha Vencimiento (excluida).

- **Base de cálculo para el devengo de intereses:** 30/360.

- **Convención Día Hábil:** en el caso de que alguna de las Fechas de Pago de los intereses coincidiera con un día no hábil según calendario TARGET2, tal fecha se trasladará al Día Hábil inmediatamente posterior (*following adjusted*).

- **Fecha de inicio de devengo de los intereses correspondientes a los Cupones Variables:** 20 de febrero de 2018
- **Fecha de Pago de los Cupones Variables:** anuales, los días 20 de febrero de cada año, siendo la primera Fecha de Pago de Cupón Variable el 20 de febrero de 2019 y la Fecha de Vencimiento la última Fecha de Pago de Cupón Variable, todo ello de acuerdo con la Convención Día Hábil expuesta anteriormente.
- **Información sobre rentabilidad histórica y previsible del Subyacente y sobre su volatilidad:**

El siguiente cuadro incluye la evolución mensual del Subyacente desde el 12 de febrero de 2017 al 12 de febrero de 2018.

FECHA	CMS 20 años (EUAMDB20 Index)
13/02/2017	1,348
13/03/2017	1,420
12/04/2017	1,230
12/05/2017	1,374
12/06/2017	1,337
12/07/2017	1,516
14/08/2017	1,407
12/09/2017	1,407
12/10/2017	1,482
13/11/2017	1,461
12/12/2017	1,342
12/01/2018	1,468
12/02/2018	1,609

- La información sobre el índice puede obtenerse a través de las siguientes plataformas financieras: Reuters (página EURSFIXA20Y) y Bloomberg (página EUAMDB20 Index)

**10.** Tipo de interés con estructura ligada a un subyacente: N/A

**11.** Cupón cero: N/A

**12.** Opciones de amortización anticipada

- Por parte del Emisor:  
No existen opciones de amortización anticipada por parte del Emisor más allá de la posibilidad de que pueda amortizar anticipadamente los Bonos Estructurados que, por cualquier causa, obren en su poder y posesión legítima.
- Por parte del Inversor:  
No existen opciones de amortización anticipada por parte del Inversor.

**13.** Fecha de amortización final y sistema de amortización:

- Fecha de Amortización Final: 20 de febrero de 2033, sujeto a lo dispuesto en la Convención Día Hábil.
- Precio de Amortización Final: a la par

14. Activos de sustitución y/o instrumentos financieros derivados vinculados: No
15. TIR para el Tomador de los Valores:  
Dado que se trata de una emisión cuyo tipo de interés variable está referenciado a un índice y que para cada periodo anual se fija dos días hábiles antes del inicio de dicho periodo, no es posible calcular a priori una TIR definitiva.  
  
No obstante, tomando el CMS 20 años (EUAMDB20 Index ) de 12 de febrero de 2018 (1,609%) y suponiendo que dicho tipo de interés de referencia se mantuviera constante hasta el vencimiento de la Emisión y que el inversor mantiene la inversión hasta el vencimiento, la TIR resultante de acuerdo con ello sería de 1,522%
16. Representación de los inversores:
- Constitución del sindicato: No
  - Identificación del Comisario: N/A

## **DISTRIBUCIÓN Y COLOCACIÓN**

17. Colectivo de Potenciales Suscriptores a los que se dirige la emisión: contrapartes elegibles, tanto nacionales como extranjeras.  
  
En cumplimiento de lo dispuesto en la Directiva 2014/65/UE (“**MiFID II**”), el Emisor declara que la Emisión está diseñada para ser comercializadas o vendidas a contrapartes elegibles, tanto nacionales como extranjeras, tal y como estos se definen en MiFID II. Cualquier canal para la distribución a contrapartes elegibles de la Emisión será adecuado.
18. Importe de suscripción mínimo/máximo: importe de suscripción mínimo de CIEN MIL EUROS (100.000 Euros) e importe de suscripción máximo equivalente al importe de la emisión.
19. Periodo de Solicitud de Suscripción: desde las 12:00 horas CET hasta las 13:00 horas CET del día 8 de febrero de 2018
20. Plazos de oferta pública y descripción del proceso de solicitud: N/A
21. Procedimiento de adjudicación y colocación de los valores: N/A
22. Métodos y plazos para el pago y entrega de los valores: N/A
23. Publicación de los resultados: N/A
24. Entidades Directoras: N/A
25. Entidades Aseguradoras: N/A
26. Entidades Colocadoras: N/A
27. Entidades Coordinadoras: N/A
28. Entidades de Contrapartida y Obligaciones de Liquidez: N/A.

## **INFORMACIÓN OPERATIVA DE LOS VALORES**

29. Agente de Pagos: CAIXABANK, S.A.
30. Entidad Depositaria: N/A
31. Agente de Cálculo: Analistas Financieros Internacionales (AFI), con domicilio social en Madrid (28010), calle España 19.

32. Calendario relevante para el pago de los flujos establecidos en la emisión: TARGET 2 y bancos comerciales abiertos para la realización de operaciones financieras en Barcelona.
33. Entidad de liquidez: N/A.
34. Liquidación de los valores: Sociedad de Gestión de los Sistemas de Registro, Compensación y Liquidación de Valores, S.A.U.: (IBERCLEAR), con domicilio social en la Plaza de la Lealtad, nº1, Madrid. Asimismo, el Emisor se compromete a facilitar la compensación y liquidación de los Valores a través de Clearstream Banking, *société anonyme* y Euroclear Bank S.A./N.V

#### OTRA INFORMACIÓN RELEVANTE SOBRE LOS VALORES Y LA EMISIÓN

35. Acuerdos de la emisión: Los acuerdos para realizar la emisión, los cuales se encuentran plenamente vigentes a la fecha de las presentes Condiciones Finales son los siguientes:
- Junta General de Accionistas de 25 de abril de 2013
  - Consejo de Administración de 25 de abril de 2013 por el que se aprueba la emisión y puesta en circulación de valores representativos de empréstito en su modalidad de Notas, Bonos u Obligaciones Estructuradas, con o sin capital garantizado, por un importe total máximo de MIL MILLONES DE EUROS (EUR 1.000.000.000) o su contravalor en divisa, a un plazo máximo de cincuenta años, en una o varias emisiones dirigidas a todo tipo de inversores, tanto nacionales como extranjeros, pudiendo solicitarse su admisión a negociación en cualquier mercado nacional o extranjero y su inclusión en cualquier sistema de compensación y liquidación.
  - El Acuerdo del Consejo de Administración de fecha 22 de junio de 2017, en virtud del cual se aprobó la elaboración de un Folleto de Base de Valores No Participativos, por un importe nominal máximo de QUINCE MIL MILLONES DE EUROS (EUR 15.000.000.000), al objeto de llevar a cabo, al amparo del mismo y como Folleto Base, la emisión de valores de renta fija y estructurados.
36. Rating: La emisión de Bonos Estructurados Febrero I 2018 no ha sido calificada por ninguna agencia de calificación crediticia.
37. Gastos de la admisión:

Concepto	Importe
Tasa de supervisión admisión CNMV	-
Admisión a cotización AIAF	2.000 Euros
Tasas de alta en IBERCLEAR	500 Euros
Otros	N/A
<b>Total Gastos</b>	<b>2.500 Euros</b>

38. Teniendo en cuenta los gastos de la tabla anterior, los ingresos netos ascienden a: N/A
39. Mercados regulados en los que están admitidos a cotización los valores de la misma clase emitidos por CAIXABANK: AIAF, Mercado de Renta Fija.
40. Intereses particulares de las personas físicas o jurídicas participantes en la emisión: N/A
41. Motivos de la emisión y destino de los ingresos: N/A

**OTRA INFORMACIÓN ADICIONAL (Información a opción del Emisor)**

- 42. Disposiciones adicionales, no exigidas en la correspondiente nota sobre los valores relativa al subyacente: N/A.
- 43. Ejemplos: N/A
- 44. País o países donde tiene lugar la oferta u ofertas públicas: N/A
- 45. País donde se solicita la admisión a cotización: España (AIAF, Mercado de Renta Fija)

14 de febrero de 2018

CAIXABANK, S.A.  
P.P.

---

D. Javier Pano Riera  
Director Ejecutivo de Finanzas