

CONDICIONES FINALES

EMISIÓN DE BONOS SIMPLES 2 /2018 DE BANCO DE SABADELL, S.A. POR IMPORTE DE 6.000.000-EUROS

Emitida bajo el Folleto Base de
Valores No Participativos 2017, registrado en la
Comisión Nacional de Mercado de Valores el día 11 de abril de 2017

Se advierte:

- a) que 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 Base¹ y el suplemento o suplementos al mismo que pudieran publicarse²;
- b) que el folleto de base y su suplemento o suplementos² se encuentran publicados en la página web de Banco Sabadell,

https://www.grupbancsabadell.com/es/XTD/INDEX/?url=/es/INFORMACION_ACCIONISTAS_E_INVERSORES/INFORMACION_FINANCIERA/EMISIONES_Y_FOLLETOS/?menuid=39324&language=es

y en la página web de la CNMV, www.cnmv.es, de conformidad con lo dispuesto en el artículo 14 de la Directiva 2003/71/CE;

- c) que, 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 Banco de Sabadell, S.A., con domicilio social en Alicante 03007, Avenida Óscar Esplá, 37 y N.I.F. número A08000143 (en adelante, el "Emisor" o la "Entidad Emisora").

1. DESCRIPCIÓN, CLASE Y CARACTERÍSTICAS DE LOS VALORES EMITIDOS

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

- 1.1 **Emisor:** Banco de Sabadell, S.A.
- 1.2 **Garante y naturaleza de la garantía:** la emisión de los Bonos no tendrá garantías reales ni de terceros, pero se encuentra garantizada en su totalidad con el patrimonio universal del Emisor.
- 1.3 **Naturaleza y denominación de los valores:**
 - Emisión Bonos Simples 2/2018 de Banco de Sabadell, S.A.
 - Código ISIN: ES0213860291.

¹ El Folleto de Base incorpora por referencia el Documento de Registro de Banco Sabadell, registrado en CNMV el 30 de marzo de 2017.

² A la fecha de las presentes Condiciones Finales se ha publicado un Suplemento al Folleto de Base registrado en CNMV con fecha 14 de diciembre de 2017

- Los Valores objeto de la presente emisión podrán ser fungibles con otros bonos simples del Emisor de posterior emisión.
 - Divisa de la emisión: Euros.
- 1.4 **Representación de los valores:** Anotaciones en Cuenta cuyo registro contable será gestionado por Sociedad de Gestión de los Sistemas de Registro, Compensación y Liquidación de Valores, S.A. Unipersonal (IBERCLEAR), con domicilio social en la plaza de la Lealtad, n.º 1, Madrid, junto con sus entidades participantes.
- 1.5 **Importe nominal y efectivo de la emisión:**
- Nominal: 6.000.000.-Euros.
 - Efectivo: 6.000.000.- Euros.
- 1.6 **Importe nominal y efectivo de los valores / número de valores:**
- Nominal unitario: 100.000.-Euros.
 - Valor de Emisión: 100%.
 - Efectivo inicial: 100.000.-Euros por valor.
 - Número de valores: 60
- 1.7 **Fecha de emisión y desembolso:** 16 de marzo de 2018.
- 1.8 **Fecha de vencimiento:** 17 de marzo de 2025.
- 1.9 **Tipo de interés fijo:** N.A.
- 1.10 **Tipo de interés variable:** MAX (0.67%, EURIBOR 3 MONTH) ajustado por la Base de Cálculo para el devengo de intereses que se indicará más adelante y pagadero trimestralmente.
- Tipo de Subyacente: *Tipo de Interés de Referencia EURIBOR 3 MESES*
 - Nombre y descripción del subyacente en el que se basa: El subyacente es el tipo de interés denominado EURIBOR 3 MONTH ACT/360 (Bloomberg:EUR003M Index) y que se publica diariamente en la página del sistema de información Bloomberg a las 11.00 horas (C.E.T.).
 - Indicación de dónde puede obtenerse información sobre rentabilidad histórica y previsible del subyacente y sobre su volatilidad: Página del sistema de información Bloomberg y Reuters.
 - Fórmula de Cálculo: La emisión a 7 años devenga trimestralmente un cupón ligado al tipo de interés denominado EURIBOR 3 MONTH (Bloomberg:EUR003M Index) y se calculará de acuerdo con la siguiente expresión:
- $$\text{Nominal} \times \text{MAX} (0.67\%, \text{Subyacente} (j)) \times \text{Tiempo}$$
- Siendo:
- Nominal = Importe Nominal de los Valores.
 - Subyacente(j) = valor de referencia del subyacente en la Fecha de determinación del tipo de interés, esto es, el segundo día hábil

anterior al de inicio del periodo del devengo de interés correspondiente.

- Tiempo = fracción anual, entre la Fecha de Inicio de Periodo(j) y la Fecha de Fin Periodo(j) del periodo de devengo según indicado en la tabla a continuación, calculada en base ACT/360 Adjusted

– Margen aplicable: N.A.

– Fechas de determinación del tipo de interés aplicable: El segundo día hábil anterior al de inicio del período de devengo del interés correspondiente, siendo el primer día de determinación el 14 de marzo de 2018.

– Especificaciones del redondeo: Si bien los porcentajes se calculan con todos sus decimales, la cantidad final a pagar al inversor se redondea al segundo decimal.

– Procedimiento de publicación de la fijación de los nuevos tipos de interés: El tipo de interés de referencia y el importe del cupón se comunicarán a los tenedores de los valores en el plazo máximo de dos días hábiles a partir de su determinación, por un medio contrastable.

– Base de cálculo para el devengo de intereses: Act/360 Adjusted.

– Convención día hábil: Si cualquiera de las Fechas de Valoración o Fecha de Liquidación no fuera un Día Hábil a efectos de cálculo del Subyacente o de liquidación de pago del cupón se aplicará la Convención “Modified Following”.

– Fecha de inicio de devengo de intereses: Según lo indicado en la tabla a continuación.

– Fecha de pago de los cupones: cupones pagaderos trimestralmente, comenzando el 18 de junio de 2018 hasta la fecha de vencimiento el 17 de marzo de 2025.

(j)	Fecha de determinación del Valor de Referencia del EUR003M Index	Periodo de devengo		Fechas de Pago cupones(j)
		Inicio Periodo(j)	Fin Periodo(j)	
1	14/03/2018	16/03/2018	18/06/2018	18/06/2018
2	14/06/2018	18/06/2018	17/09/2018	17/09/2018
3	13/09/2018	17/09/2018	17/12/2018	17/12/2018
4	13/12/2018	17/12/2018	18/03/2019	18/03/2019
5	14/03/2019	18/03/2019	17/06/2019	17/06/2019
6	13/06/2019	17/06/2019	16/09/2019	16/09/2019
7	12/09/2019	16/09/2019	16/12/2019	16/12/2019
8	12/12/2019	16/12/2019	16/03/2020	16/03/2020
9	12/03/2020	16/03/2020	16/06/2020	16/06/2020
10	12/06/2020	16/06/2020	16/09/2020	16/09/2020

11	14/09/2020	16/09/2020	16/12/2020	16/12/2020
12	14/12/2020	16/12/2020	16/03/2021	16/03/2021
13	12/03/2021	16/03/2021	16/06/2021	16/06/2021
14	14/06/2021	16/06/2021	16/09/2021	16/09/2021
15	14/09/2021	16/09/2021	16/12/2021	16/12/2021
16	14/12/2021	16/12/2021	16/03/2022	16/03/2022
17	14/03/2022	16/03/2022	16/06/2022	16/06/2022
18	14/06/2022	16/06/2022	16/09/2022	16/09/2022
19	14/09/2022	16/09/2022	16/12/2022	16/12/2022
20	14/12/2022	16/12/2022	16/03/2023	16/03/2023
21	14/03/2023	16/03/2023	16/06/2023	16/06/2023
22	14/06/2023	16/06/2023	18/09/2023	18/09/2023
23	14/09/2023	18/09/2023	18/12/2023	18/12/2023
24	14/12/2023	18/12/2023	18/03/2024	18/03/2024
25	14/03/2024	18/03/2024	17/06/2024	17/06/2024
26	13/06/2024	17/06/2024	16/09/2024	16/09/2024
27	12/09/2024	16/09/2024	16/12/2024	16/12/2024
28	12/12/2024	16/12/2024	17/03/2025	17/03/2025

– Importes Irregulares: N.A.

– Tipo Mínimo: 0.67%; ajustado por la Base de cálculo

– Tipo Máximo: N.A

1.11 **Tipo de interés indexado:** N.A.

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

1.13 **Cupón Cero:** N.A.

1.14 **Opciones de amortización o cancelación anticipada:**

– Para el emisor: No.

– Para el inversor: No.

– Obligatoria: No.

1.15 **Fecha de amortización final y sistema de amortización:**

– Fecha: 17 de marzo de 2025

- Valor de amortización final: Según lo dispuesto a continuación.
 - Estructura de Amortización Final: Los valores amortizarán a la par, esto es, el inversor recuperará el 100% del importe nominal de los mismos en la Fecha de amortización final, esto es, el 17 de marzo de 2025.
 - Tipo de Subyacente/s: Ver apartado 1.10
 - Nombre/s de Subyacente/s: Ver apartado 1.10.
 - Indicación de dónde puede obtenerse información sobre rentabilidad histórica y previsible del subyacente y sobre su volatilidad: Ver apartado 1.10.
 - Ponderación de los subyacentes: N.A.
 - Valor Inicial del Subyacente: Es el valor de cierre del subyacente publicado en la página del sistema de información Bloomberg a las 11.00 horas (C.E.T.) del día 14 de marzo de 2018.
 - Disposiciones relativas al Valor de Referencia del Subyacente: ver apartado 1.10.
 - Fecha de Determinación del Valor Final: 12 de diciembre de 2024
 - Barreras: N.A.
- 1.16 **Activos de sustitución y/o instrumentos derivados vinculados:** N.A.
- 1.17 **TIR para el tomador de los Valores:** Dado que se trata de una emisión cuyo pago de cupón depende de la evolución del Subyacente, en los escenarios que se reflejan en el apartado. 1.41 se refleja la TIR para un Bono en función de lo que pueda acontecer.
- RATING**
- 1.18 **Rating de la Emisión:** La emisión no ha sido calificada por ninguna agencia.
- DISTRIBUCIÓN Y COLOCACIÓN**
- 1.19 **Colectivo de potenciales suscriptores a los que se dirige la emisión:** La inversión se ha dirigido a inversores cualificados.
- 1.20 **Importe de suscripción mínimo / máximo:** N.A.
- 1.21 **Período de solicitud de Suscripción:** La solicitud de suscripción ha tenido lugar desde el 23 de febrero de 2018 a las 9:00 horas hasta el 7 de marzo de 2018 a las 17:30 horas.
- 1.22 **Plazos de la oferta pública y descripción del proceso de solicitud:** N.A.
- 1.23 **Procedimiento de adjudicación y colocación de los valores:** N.A.
- 1.24 **Método y plazos de entrega de los valores:** N.A.
- 1.25 **Publicación de los resultados:** N.A.
- 1.26 **Entidades Directoras:** N.A.
- Entidades Co- Directoras:** N.A.

- 1.27 **Entidades Aseguradoras:** N.A.
- 1.28 **Entidades Colocadoras:** Banco de Sabadell, S.A. con domicilio social en Alicante 03007, Avenida Oscar Esplá, 37.
- 1.29 **Entidades Coordinadoras:** N.A.
- 1.30 **Entidades de Contrapartida y Obligaciones de Liquidez:** N.A.

- INFORMACIÓN OPERATIVA DE LOS VALORES

- 1.31 **Agente de Cálculo:** Banco de Sabadell, S.A.
- 1.32 **Agente de Pagos:** Banco de Sabadell, S.A. con domicilio social en Alicante 03007, Avenida Oscar Esplá, 37.
- 1.33 **Calendario relevante para el pago de los flujos establecidos en la emisión:** TARGET.
- 1.34 **Entidades Depositarias:** N.A.
- 1.35 **Entidades de liquidez:** N.A.
- 1.36 **Liquidación de los valores:** La llevanza, liquidación y compensación de los valores se realizará a través de la Sociedad de Gestión de Sistemas de Registro, Compensación y Liquidación de Valores, S.A. Unipersonal (IBERCLEAR).

- INFORMACIÓN ADICIONAL

- 1.37 **Gastos de la emisión:**
- Comisiones:** N.A. al no existir Entidades Colocadoras.
- Gastos CNMV:** 500.-Euros.
- Gastos AIAF:** 2.000.-Euros.
- Gastos Iberclear:** 605.- Euros.
- Total gastos de la emisión:** 3.105.-Euros.
- 1.38 **Mercados regulados en los que están admitidos a cotización los valores de la misma clase emitidos por Banco de Sabadell, S.A.:** AIAF Mercado de Renta Fija.
- 1.39 **País o países donde tiene lugar la oferta u ofertas públicas:** N.A.
- 1.40 **País donde se solicita la admisión a cotización en uno o varios mercados regulados:** España. Se solicitará la admisión a negociación de los valores objeto de emisión en AIAF Mercado de Renta Fija. Se prevé su cotización en un plazo inferior a 1 mes desde la Fecha de desembolso.
- 1.41 **Ejemplos:** N.A.

1.42 **Disposiciones adicionales, no exigidas en la correspondiente nota sobre los valores relativa al subyacente:** N.A.

2. **ACUERDOS DE EMISIÓN DE LOS VALORES Y DE CONSTITUCIÓN DEL SINDICATO DE TENEDORES DE BONOS ESTRUCTURADOS**

Las resoluciones y acuerdos por los que se procede a la realización de la presente emisión, los cuales se encuentran plenamente vigentes a la fecha de las presentes Condiciones Finales, son los que se enuncian a continuación:

- Acuerdo del Consejo de Administración de fecha 23 de febrero de 2017
- Acuerdo de emisión de D. Tomás Varela Muiña y D. Ramón de la Riva Reina de fecha 23 de febrero de 2018.

De conformidad con el epígrafe 4.10 del Folleto Base al amparo del que se realiza la presente emisión de valores y según las reglas y el Reglamento previstos en él en relación con la constitución del Sindicato de Tenedores de Bonos Estructurados denominado "*Sindicato de Tenedores de la Emisión de Bonos Simples 2/2018 de Banco de Sabadell S.A.*".

Se ha nombrado Comisario del Sindicato a D^a Sonia Quibus Rodríguez quien ha aceptado el cargo y tendrá las facultades que le atribuye el Reglamento incluido en el epígrafe 4.10 del Folleto Base mencionado anteriormente.

En Sant Cugat del Vallés, a ... de marzo de 2018

Banco de Sabadell, S.A.

P.p.

D. Sergio Alejandro Palavecino Tomé