

CONDICIONES FINALES

**EMISIÓN DE BONOS SABADELL 4 /2019 DE BANCO DE SABADELL, S.A.
POR IMPORTE DE 120.000.000.- EUROS
Emitida bajo el Folleto Base de
Valores No Participativos 2019, registrado en la
Comisión Nacional de Mercado de Valores el día 4 de Julio de 2019**

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 publicarse;
- b) que el folleto de base y su suplemento o suplementos 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.

Código LEI: SI5RG2M0WQQLZCXKRM20.

1.2 Naturaleza y denominación de los valores:

- Bonos Simples Ordinarios: Emisión de Bonos Sabadell 4/2019 de Banco de Sabadell, S.A.
- Código ISIN: ES03138603H6
- La presente emisión no será fungible con futuras emisiones de similares características.

¹ El Folleto de Base incorpora por referencia el Documento de Registro de Banco Sabadell, registrado en CNMV el 15 de abril de 2019.

- Divisa de la emisión: Euros.
- 1.3 **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.
- 1.4 **Importe nominal y efectivo de la emisión:**
 - Nominal: 120.000.000.-Euros.
 - Efectivo: 120.000.000 .- Euros.
- 1.5 **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: 1.200
- 1.6 **Fecha de emisión y desembolso:** 15 de noviembre de 2019.
- 1.7 **Fecha de vencimiento:** 15 de mayo de 2024.
- 1.8 **Tipo de interés fijo:** N.A.
- 1.9 **Tipo de interés variable:** MAX (0,00%, 0,60 % + EURIBOR 3 MONTH) ajustado por la Base de Cálculo para el devengo de intereses que se indicará más adelante y pagadero trimestralmente.

El índice de referencia utilizado ha sido elaborado por The European Money Markets Institute (EMMI), con sede en Bruselas, que según la disposición transitoria, Artículo 51 del Reglamento (UE) 2016/1011 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 8 de junio de 2016, relativo al uso de índices de referencia en los instrumentos financieros, dicho proveedor de índices a fecha de las presentes Condiciones Finales no está obligado a su inscripción registral.

– 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 4 años y medio 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:

$$\text{Nominal} \times \text{MAX} (0,0000\%, 0,60\% + \text{Subyacente} (j)) \times \text{Tiempo}$$

Siendo:

- Nominal = Importe Nominal de los Valores.

- Subyacente(j) = Precio 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 13 de noviembre de 2019.

– 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.

– 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 adjusted”.

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 17 de febrero de 2020 hasta la fecha de vencimiento el 15 de mayo de 2024

Fecha de determinación del Precio de Referencia del EUR003M Index	Inicio Periodo(j)	Fin Periodo(j)	Fechas de Pago cupones(j)
13/11/2019	15/11/2019	17/02/2020	17/02/2020
13/02/2020	17/02/2020	15/05/2020	15/05/2020
13/05/2020	15/05/2020	17/08/2020	17/08/2020
13/08/2020	17/08/2020	16/11/2020	16/11/2020
12/11/2020	16/11/2020	15/02/2021	15/02/2021
11/02/2021	15/02/2021	17/05/2021	17/05/2021
13/05/2021	17/05/2021	16/08/2021	16/08/2021
12/08/2021	16/08/2021	15/11/2021	15/11/2021
11/11/2021	15/11/2021	15/02/2022	15/02/2022
11/02/2022	15/02/2022	16/05/2022	16/05/2022

12/05/2022	16/05/2022	15/08/2022	15/08/2022
11/08/2022	15/08/2022	15/11/2022	15/11/2022
11/11/2022	15/11/2022	15/02/2023	15/02/2023
13/02/2023	15/02/2023	15/05/2023	15/05/2023
11/05/2023	15/05/2023	15/08/2023	15/08/2023
11/08/2023	15/08/2023	15/11/2023	15/11/2023
13/11/2023	15/11/2023	15/02/2024	15/02/2024
13/02/2024	15/02/2024	15/05/2024	15/05/2024

– Importes Irregulares: N.A.

– Tipo Mínimo: 0,00%

– Tipo Máximo: N.A

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

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

1.12 **Cupón Cero:** N.A.

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

- Para el emisor: No.
- Para el inversor: No.
- Obligatoria: No.
- Importe/s de la amortización: Total
- Precio/s de Amortización anticipada en caso de Evento de Elegibilidad: 100% del nominal.

1.14 **Evento de Elegibilidad:** Aplicable

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

- Fecha: 15 de mayo de 2024,
- Precio de amortización final: 100% del nominal.
- 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 15 de mayo de 2024

- Tipo de Subyacente: ver apartado 1.9
- Nombre/s de Subyacente/s: ver apartado 1.9
- Indicación de dónde puede obtenerse información sobre rentabilidad histórica y previsible del subyacente y sobre su volatilidad: ver apartado 1.9
- Ponderación de los subyacentes: N/A.
- Precio Inicial del Subyacente: ver apartado 1.9 Es el precio de cierre del subyacente publicado en la página del sistema de información Bloomberg a las 11.00 horas (C.E.T.) del día 13 de noviembre de 2019.
- Disposiciones relativas al Precio de Referencia del Subyacente: ver apartado 1.9
- Fecha de Determinación del Precio Final: 13 de febrero de 2024

1.16 **Activos de sustitución y/o instrumentos derivados vinculados:** N.A.

1.17 **TIR para el tomador de los Valores:** Se trata de una emisión cuyo pago de cupón depende de la evolución del Índice Subyacente.

- 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 contrapartes elegibles y clientes profesionales.

1.20 **Importe de suscripción mínimo / máximo:** N.A.

1.21 **Período de solicitud de Suscripción:** El periodo de suscripción ha tenido lugar desde el 28 de octubre de 2019 a las 9:00 horas hasta el 8 de noviembre de 2019 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:** IBERCLEAR.

- INFORMACIÓN ADICIONAL

1.37 **Gastos de la emisión:**

Comisiones: N.A. al no existir Entidades Colocadoras.

Gastos CNMV:- 500 Euros.

Gastos AIAF:- 1.100 Euros sin IVA.

Gastos Iberclear: 750 Euros sin IVA.

Total gastos de la emisión:- 2.350 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.

1.41 **Ejemplos:** N.A.

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

1.43 **Finalidad de la emisión y destino de los importes netos obtenidos:** El cómputo de los valores en el importe de Pasivos Admisibles del Emisor y de su Grupo.

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 28 de marzo de 2019.

- Acuerdo de emisión de D. Tomás Varela Muiña y D. Sergio Alejandro Palavecino Tomé de fecha 28 de octubre de 2019.

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, para la presente emisión de valores se procede a la constitución del Sindicato de Tenedores de Bonos denominado "*Sindicato de Tenedores de la Emisión de Bonos Sabadell 4/2019 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 12 de noviembre de 2019

Banco de Sabadell, S.A.

P.p.

D. Sergio Alejandro Palavecino Tomé

