

RZB Zinscap EUR 4.00 / 2009-2019 / tilgend

Emittentin	Raiffeisen Zentralbank Österreich AG
Art des Wertpapiers	Zinscap-Optionsschein
Währung	Euro (EUR)
Volumen	Gesamtstückzahl beträgt bis zu 50.000 Stück.
Stückelung	EUR 1.000.-
Emissionsbeginn	01.04.2009
Berechnungsperiodebeginn	30.06.2009
Verfallstag	30.06.2019
Basiswert	3-Monat-EURIBOR (Euro Interbank Offered Rate), Reuters Seite „EURIBOR01“, ca. 11:00 Brüssel Zeit, auf drei Dezimalstellen gerundet
Basiszinssatz	4,00 % pro Jahr
Optionsrecht	<p>Ausgleichszahlung in Euro pro Stück eines Zinscap-Optionsscheins, wenn 3-Monat-EURIBOR-Satz > Basiszinssatz am Marktzinssatz-Feststellungstag dann: $1.000 \times \text{Differenzzinssatz} \times t \times F / 360$</p> <p>„t“ = die tatsächliche Anzahl der Tage für die jeweilige Zinsenlaufperiode</p> <p>„F“ ist der Faktor gegenständlicher tilgender Ausgestaltung des Zinscap-Optionsscheins, wobei sich der zugrunde liegende Nominalbetrag von EUR 1.000,- linear um EUR 25,- pro Quartal bis zum Ende der Laufzeit reduziert.</p>
Marktzinssatz-Feststellungstag	Jener Tag, an welchem der aktuelle Marktzinssatz des Basiswertes 3-Monats-EURIBOR (ausgedrückt in einem Zahlenwert von Hundert) zwecks Errechnung des maßgeblichen Differenzzinssatzes für die nachfolgende Berechnungsperiode ermittelt wird. Der maßgebliche Marktzinssatz-Feststellungstag für eine Berechnungsperiode liegt jeweils am zweiten Bankarbeitstag vor deren Beginn (erstem Tag der Berechnungsperiode).
Berechnungsperiode	Berechnungsperioden sind a) der Zeitraum erstmals zwischen dem 30.06.2009 (inklusive) und dem nächstfolgenden Ausübungstag (exklusive), und b) weiters die Zeiträume zwischen einem Ausübungstag (inklusive) und dem unmittelbar darauf folgenden Ausübungstag bzw. dem Verfallstag (exklusive) gemäß Annex 1.
Ausübungstag(e)	Als Ausübungstage sind der 31. März, 30. Juni, 30. September und 31. Dezember (erstmalig der 30. Juni 2009) eines jeden Laufzeitjahres der Zinscap-Optionsscheine bis zum Verfallstag (inklusive) festgelegt. Der letzte Ausübungstag ist der Verfallstag.
Differenzzinssatz	Der Differenzzinssatz (ausgedrückt in einem Zahlenwert von Hundert pro Jahr) ist die positive Differenz, um die der aktuelle Marktzinssatz, berechnet an jedem Marktzinssatz-Feststellungstag, den Basiszinssatz übersteigt.

Interne WKN	QOXDBA006364
Settlement	Cash-Settlement
Zahl-, Einreich- und Optionsstelle	Raiffeisen Zentralbank Österreich AG
Erstausgabepreis	Der Erstausgabepreis und die weiteren Ausgabepreise ("Optionspreise") werden in Abhängigkeit von der Marktlage laufend festgelegt. Als Höchstausgabepreis gemäß § 7 Abs. 5 Ziffer 1 KMG wurden EUR 300,- pro Stück festgelegt.
Website für Bekanntmachungen	www.rzb.at

ANNEX 1

Markzinssatz-Feststellungstag Berechnungsperiode Beginn, Ausübungstag, Faktor

Verfallstag: 30.06.2019

Marktzinssatz- Feststellungstag	Berechnungszeitraum Beginn	Ausübungstag	Faktor
26.06.2009	30.06.2009	30.09.2009	1,000
28.09.2009	30.09.2009	31.12.2009	0,975
29.12.2009	31.12.2009	31.03.2010	0,950
29.03.2010	31.03.2010	30.06.2010	0,925
28.06.2010	30.06.2010	30.09.2010	0,900
28.09.2010	30.09.2010	31.12.2010	0,875
29.12.2010	31.12.2010	31.03.2011	0,850
29.03.2011	31.03.2011	30.06.2011	0,825
28.06.2011	30.06.2011	30.09.2011	0,800
28.09.2011	30.09.2011	30.12.2011	0,775
28.12.2011	30.12.2011	30.03.2012	0,750
28.03.2012	30.03.2012	29.06.2012	0,725
27.06.2012	29.06.2012	28.09.2012	0,700
26.09.2012	28.09.2012	31.12.2012	0,675
27.12.2012	31.12.2012	28.03.2013	0,650
26.03.2013	28.03.2013	28.06.2013	0,625
26.06.2013	28.06.2013	30.09.2013	0,600
26.09.2013	30.09.2013	31.12.2013	0,575
27.12.2013	31.12.2013	31.03.2014	0,550
27.03.2014	31.03.2014	30.06.2014	0,525
26.06.2014	30.06.2014	30.09.2014	0,500
26.09.2014	30.09.2014	31.12.2014	0,475
29.12.2014	31.12.2014	31.03.2015	0,450
27.03.2015	31.03.2015	30.06.2015	0,425
26.06.2015	30.06.2015	30.09.2015	0,400
28.09.2015	30.09.2015	31.12.2015	0,375
29.12.2015	31.12.2015	31.03.2016	0,350
29.03.2016	31.03.2016	30.06.2016	0,325
28.06.2016	30.06.2016	30.09.2016	0,300
28.09.2016	30.09.2016	30.12.2016	0,275
28.12.2016	30.12.2016	31.03.2017	0,250
29.03.2017	31.03.2017	30.06.2017	0,225
28.06.2017	30.06.2017	29.09.2017	0,200
27.09.2017	29.09.2017	29.12.2017	0,175
27.12.2017	29.12.2017	29.03.2018	0,150
27.03.2018	29.03.2018	29.06.2018	0,125
27.06.2018	29.06.2018	28.09.2018	0,100
26.09.2018	28.09.2018	31.12.2018	0,075
27.12.2018	31.12.2018	29.03.2019	0,050
27.03.2019	29.03.2019	28.06.2019	0,025