

RZB Zinscap EUR 3.50 / 2009-2024 / 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	20.05.2009
Berechnungsperiodebeginn	30.06.2009
Verfallstag	30.06.2024
Basiswert	3-Monat-EURIBOR (Euro Interbank Offered Rate), Reuters Seite „EURIBOR01“, ca. 11:00 Brüssel Zeit, auf drei Dezimalstellen gerundet
Basiszinssatz	3,50 % 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	QOXDBA007743
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: 30.06.2024

Marktzinssatz- Feststellungstag	Berechnungszeitraum		Faktor
	Beginn	Ausübungstag	
26.06.2009	30.06.2009	30.09.2009	1,000
28.09.2009	30.09.2009	31.12.2009	0,983
29.12.2009	31.12.2009	31.03.2010	0,966
29.03.2010	31.03.2010	30.06.2010	0,950
28.06.2010	30.06.2010	30.09.2010	0,933
28.09.2010	30.09.2010	31.12.2010	0,916
29.12.2010	31.12.2010	31.03.2011	0,900
29.03.2011	31.03.2011	30.06.2011	0,883
28.06.2011	30.06.2011	30.09.2011	0,866
28.09.2011	30.09.2011	30.12.2011	0,850
28.12.2011	30.12.2011	30.03.2012	0,833
28.03.2012	30.03.2012	29.06.2012	0,816
27.06.2012	29.06.2012	28.09.2012	0,800
26.09.2012	28.09.2012	31.12.2012	0,783
27.12.2012	31.12.2012	28.03.2013	0,766
26.03.2013	28.03.2013	28.06.2013	0,750
26.06.2013	28.06.2013	30.09.2013	0,733
26.09.2013	30.09.2013	31.12.2013	0,716
27.12.2013	31.12.2013	31.03.2014	0,700
27.03.2014	31.03.2014	30.06.2014	0,683
26.06.2014	30.06.2014	30.09.2014	0,666
26.09.2014	30.09.2014	31.12.2014	0,650
29.12.2014	31.12.2014	31.03.2015	0,633
27.03.2015	31.03.2015	30.06.2015	0,616
26.06.2015	30.06.2015	30.09.2015	0,600
28.09.2015	30.09.2015	31.12.2015	0,583
29.12.2015	31.12.2015	31.03.2016	0,566
29.03.2016	31.03.2016	30.06.2016	0,550
28.06.2016	30.06.2016	30.09.2016	0,533
28.09.2016	30.09.2016	30.12.2016	0,516
28.12.2016	30.12.2016	31.03.2017	0,500
29.03.2017	31.03.2017	30.06.2017	0,483
28.06.2017	30.06.2017	29.09.2017	0,466
27.09.2017	29.09.2017	29.12.2017	0,450
27.12.2017	29.12.2017	29.03.2018	0,433
27.03.2018	29.03.2018	29.06.2018	0,416
27.06.2018	29.06.2018	28.09.2018	0,400
26.09.2018	28.09.2018	31.12.2018	0,383
27.12.2018	31.12.2018	29.03.2019	0,366
27.03.2019	29.03.2019	28.06.2019	0,350
26.06.2019	28.06.2019	30.09.2019	0,333
26.09.2019	30.09.2019	31.12.2019	0,316
27.12.2019	31.12.2019	31.03.2020	0,300
27.03.2020	31.03.2020	30.06.2020	0,283
26.06.2020	30.06.2020	30.09.2020	0,266

28.09.2020	30.09.2020	31.12.2020	0,250
29.12.2020	31.12.2020	31.03.2021	0,233
29.03.2021	31.03.2021	30.06.2021	0,216
28.06.2021	30.06.2021	30.09.2021	0,200
28.09.2021	30.09.2021	31.12.2021	0,183
29.12.2021	31.12.2021	31.03.2022	0,166
29.03.2022	31.03.2022	30.06.2022	0,150
28.06.2022	30.06.2022	30.09.2022	0,133
28.09.2022	30.09.2022	30.12.2022	0,116
28.12.2022	30.12.2022	31.03.2023	0,100
29.03.2023	31.03.2023	30.06.2023	0,083
28.06.2023	30.06.2023	29.09.2023	0,066
27.09.2023	29.09.2023	29.12.2023	0,050
27.12.2023	29.12.2023	28.03.2024	0,033
26.03.2024	28.03.2024	28.06.2024	0,016