

AVVISO n.10099

15 Giugno 2009

MOT – DomesticMOT

Mittente del comunicato : MERRILL LYNCH & CO.

Societa' oggetto : BEI
dell'Avviso

Oggetto : Obbligazioni – Cancellazione per rimborso

Testo del comunicato

Si veda allegato.

Disposizioni della Borsa

Il prestito obbligazionario "European Investment Bank Callable Fixed to CMS Linked Bonds due 17 June 2020" (ISIN XS0220720303) verrà cancellato dal Listino Ufficiale a far data dal 16/6/2009.

Fax

To: EIB
To: Citibank
To: Euroclear / Clearstream

Re: EUR 91.000.000 Scadenza 17 Giugno 2020

ISIN Code: XS0220720303 / BEI 05/20 FIX CMS LKD
ML Ref: 05 ML40N

Per il periodo dal 17 Giugno 2008 al 17 Giugno 2009, andrà in pagamento la cedola per il titolo sopracitato:

Nominale Residuo: EUR 91.000.000
2yrEURSwap = 5,451%
10yrEURSwap = 5,012%
Rilevati il 13 Giugno 2008

4 * RefSpread = 4 * (10yrEURSwap - 2yrEURSwap)
= 4 * (5,012 - 5,451)
= -1,756%
-1,756% < 1,5% Cedola Minima

Cedola = 1,5%
Giorni: 360/360

Calcolo Imp. Cedola = $[91.000.000 * 1,5\% * 360/360] = \text{EUR } 1.365.000$
Importo Cedola = Eur 1.365.000
Data Pagamento: 17 Giugno 2009

Richiamo Anticipato

Come previsto dal punto 18 del Pricing Supplement l'emittente ha richiamato anticipatamente il prestito in oggetto;

Issuer: EIB
ISIN: XS0220720303
Prezzo: 100%
Importo: EUR 91.000.000
Data Pagamento: 17 Giugno 2009

Saluti

Liam Graham O'Hara
OTC Structured Derivatives
Merrill Lynch International
Tel: +44 (0)20 7995 3139
Email: liam_graham@ml.com
Group: OTCSD@ml.com

