

Nachtrag

gemäß § 16 Absatz 1 Wertpapierprospektgesetz a.F.

vom 29. Januar 2020

zu den Basisprospekten

der

Citigroup Global Markets Europe AG

Frankfurt am Main

(der "Emittent")

Dieser Nachtrag der Citigroup Global Markets Europe AG, Frankfurt am Main bezieht sich auf die in der Tabelle auf Seite 12 aufgeführten Basisprospekte vom 5. Juni 2019.

Der Nachtrag und die Basisprospekte werden bei der Citigroup Global Markets Europe AG, Frankfurter Welle, Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main zur kostenlosen Ausgabe bereitgehalten und sind darüber hinaus auf der Internetseite des Emittenten www.citifirst.com unter dem Reiter Produkte>Rechtliche Dokumente abrufbar.

Nach § 16 Absatz 3 Wertpapierprospektgesetz a.F. haben Anleger, die vor der Veröffentlichung dieses Nachtrags eine auf den Erwerb oder die Zeichnung von Wertpapieren gerichtete Willenserklärung abgegeben haben, das Recht, diese innerhalb von zwei Werktagen nach der Veröffentlichung dieses Nachtrags zu widerrufen, sofern der neue Umstand oder die Unrichtigkeit vor dem endgültigen Schluss des öffentlichen Angebots und vor der Lieferung der Wertpapiere eingetreten ist.

Der Empfänger des Widerrufs ist die Citigroup Global Markets Europe AG, z.Hd. Rechtsabteilung, Frankfurter Welle, Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main. Der Widerruf muss keine Begründung enthalten und ist in Textform zu erklären. Zur Fristwahrung genügt die rechtzeitige Absendung des Widerrufs.

Gegenstand dieses Nachtrags zum Basisprospekt für die Begebung, Aufstockung, Wiederaufnahme des Angebots oder die Fortsetzung des öffentlichen Angebots von Zertifikaten bezogen auf Aktien bzw. aktienvertretende Wertpapiere, Aktienindizes, Wechselkurse, Rohstoffe, Fonds, Exchange Traded Funds, Futures-Kontrakte oder einen Korb bestehend aus Aktien bzw. aktienvertretenden Wertpapieren, Aktienindizes, Wechselkursen, Rohstoffen, Fonds, Exchange Traded Funds, Futures-Kontrakten vom 5. Juni 2019, wie nachgetragen durch Nachtrag vom 2. Oktober 2019, und zum Basisprospekt für die Begebung, Aufstockung, Wiederaufnahme des Angebots oder die Fortsetzung des öffentlichen Angebots von Optionsscheinen bezogen auf Aktien bzw. aktienvertretende Wertpapiere, Aktienindizes, Wechselkurse, Rohstoffe, Fonds, Exchange Traded Funds, Futures-Kontrakte vom 5. Juni 2019, wie nachgetragen durch Nachtrag vom 2. Oktober 2019, (die Basisprospekte zusammen die "**Basisprospekte**"), ist ein Schreiben der U.S.-amerikanischen Commodity Futures Trading Commission (CFTC) an den Emittenten, das der Emittent am 17. Januar 2020 erhalten hat und das den Emittenten veranlasst, die Verkaufsbeschränkungen in den Basisprospekten anzupassen.

Die Basisprospekte werden auf den in der Tabelle auf Seite 12 (die "**Tabelle**") genannten Seiten wie folgt geändert:

Änderungen bezüglich der Einleitung der Basisprospekte

*1. In den Basisprospekten werden im dritten Absatz der Einleitung auf den unter **Punkt 1** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten die darin enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:*

"Die Wertpapiere wurden und werden nicht gemäß dem U.S.-amerikanischen *Securities Act* von 1933 in der jeweils geltenden Fassung (der *Securities Act*) oder bei einer Wertpapieraufsichtsbehörde eines Einzelstaats oder einer anderen Gebietskörperschaft der Vereinigten Staaten registriert und es wurde und

wird keine Person als Commodity Pool Operator des Emittenten oder Commodity Trading Advisor gemäß dem U.S.-amerikanischen *Commodity Exchange Act* in der jeweils geltenden Fassung (der CEA) und den Vorschriften der U.S.-amerikanischen Commodity Futures Trading Commission in deren Rahmen (die CFTC-Vorschriften) registriert. Ferner wurde und wird der Emittent nicht als "Investmentgesellschaft" (*investment company*) gemäß dem U.S.-amerikanischen *Investment Company Act* von 1940 in der jeweils geltenden Fassung registriert. Demzufolge dürfen die Wertpapiere zu keinem Zeitpunkt angeboten, verkauft, verpfändet, weiterverkauft, geliefert oder anderweitig übertragen werden, es sei denn, dies erfolgt im Rahmen einer "Offshore-Transaktion" (*offshore transaction*) (im Sinne der Definition in Regulation S des Securities Act (Regulation S)) an Personen, die: (1) keine "U.S.-Personen" (*U.S. persons*) (im Sinne von Rule 902(k)(1) von Regulation S) sind; (2) nicht für irgendwelche Zwecke unter eine der Begriffsbestimmungen von U.S.-Person im Rahmen des CEA oder einer Vorschrift, Richtlinie oder Weisung der CFTC, die von der CFTC im Rahmen des CEA vorgeschlagen oder veröffentlicht wurde, fallen (zur Klarstellung: jede Person, die keine "Nicht-U.S.-Person" (*Non-United States person*) im Sinne der CFTC-Vorschrift 4.7(a)(1)(iv), im Sinne der Verordnung der Kommission (*Commission Regulation*) 23.160 und der CFTC's *Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*, 78 Fed. Reg. 45292 (26. Juli 2013) ist, gilt als U.S.-Person); und (3) keine "U.S.-Personen" (*United States persons*) im Sinne der Definition in Section 7701(a)(30) des U.S. Internal Revenue Code von 1986, in der jeweils geltenden Fassung (der "Code") sind (alle Personen, die unter die unmittelbar vorstehenden Punkte (1), (2) und (3) fallen, werden als Zulässige Käufer bezeichnet). Erwirbt ein Zulässiger Käufer die Wertpapiere für Rechnung oder zugunsten einer anderen Person, muss es sich bei dieser anderen Person ebenfalls um einen Zulässigen Käufer handeln. Jeder Käufer, der die Wertpapiere erwirbt, sichert zu und garantiert, dass (1) er (i) kein Altersvorsorgeplan (*employee benefit plan*), wie in Section 3 (3) des U.S. Employee Retirement Income Security Act von 1974, in der jeweils geltenden Fassung ("ERISA"), beschrieben, ist oder sein wird, der den Bestimmungen von Titel I von ERISA unterliegt, (ii) kein Plan ist oder sein wird, der in Section 4975 (e) (1) des Code beschrieben ist, und der Section 4975 des Code unterliegt, und (iii) kein Unternehmen ist oder sein wird, dass das Planvermögen eines solchen Altersvorsorgeplans oder Plans hält (jeder der (i), (ii), und (iii) wird als "Plananleger" bezeichnet), oder (iv) kein Plan ist oder sein wird, der einem Gesetz unterliegt, das den Bestimmungen zur treuhänderischen Verantwortung oder zu verbotenen Transaktionen unter ERISA oder Section 4975 des Code vergleichbar ist ("Vergleichbares Gesetz"), oder dass (2) der Erwerb und Besitz der Wertpapiere, im Fall eines Plananlegers, nicht zu einer nicht ausgenommenen, verbotenen Transaktion gemäß Section 406 ERISA, Section 4975 des Code führt, da dieser Erwerb und diese Beteiligung die Voraussetzung für eine Befreiung im Rahmen einer anwendbaren Ausnahme von verbotenen Transaktionen erfüllt, oder, im Falle eines Plans, der einem Vergleichbarem Gesetz unterliegt, nicht zu einem Verstoß gegen ein Vergleichbares Gesetz führt. Die Wertpapiere stellen keine Warenbeteiligung (*commodity interests*) nach Maßgabe des CEA dar bzw. wurden nicht als solche vertrieben, und der Handel mit den Wertpapieren wurde nicht von der U.S.-amerikanischen Commodity Futures Trading Commission im Rahmen des CEA zugelassen. Der nachstehende Abschnitt "IX. Verkaufsbeschränkungen" enthält eine Beschreibung bestimmter Beschränkungen hinsichtlich des Angebots, des Verkaufs und der Übertragung von Wertpapieren. Von jedem Käufer und Übertragungsempfänger der Wertpapiere gelten bestimmte Bestätigungen, Zusicherungen und Verpflichtungserklärungen als abgegeben, die im nachstehenden Abschnitt "X. Hinweis an die Anleger" aufgeführt sind."

Änderungen bezüglich des Abschnitts "I. Zusammenfassung"

2. In den Basisprospekten im Punkt E.3 des "Abschnitt E - Angebot" auf den unter **Punkt 2** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die im letzten Absatz vor der Unterüberschrift "Ausgabepreis sowie Kosten und Steuern beim Erwerb" enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Die Zertifikate dürfen insbesondere nicht von einem Plananleger oder von einem Plan, der Vergleichbarem Recht unterliegt, gekauft oder gehalten werden oder auf einen solchen übertragen werden, es sei denn, der Kauf oder das Halten der Zertifikate, im Fall eines Plananlegers, führt nicht zu einer nicht ausgenommenen, verbotenen Transaktion gemäß Section 406 des U.S. Employee Retirement Income Security Act von 1974, in der jeweils geltenden Fassung ("**ERISA**") oder Section 4975 des U.S. Internal Revenue Code von 1986, in der jeweils geltenden Fassung (der "**Code**"), da dieser Erwerb und diese Beteiligung die Voraussetzung für eine Befreiung im Rahmen einer anwendbaren Ausnahme von verbotenen Transaktionen erfüllt, oder im Falle eines Plans, der einem Vergleichbaren Gesetz unterliegt, zu einem Verstoß gegen ein Vergleichbares Gesetz. Für die Zwecke dieses Abschnitts bezeichnet "**Plananleger**" (*benefit plan investor*) (a) einen Altersvorsorgeplan (*employee benefit plan*) (im Sinne von Section 3(3) Title I der ERISA), (b) einen Plan im Sinne und nach Maßgabe von Section 4975 des Code, (c) jeden Rechtsträger, der das Planvermögen eines solchen Altersvorsorgeplans oder Plans hält, und "**Vergleichbares Gesetz**" bezeichnet ein Gesetz, welches der treuhänderischen Verantwortung oder verbotenen Transaktionsbestimmung von ERISA oder Abschnitt 4975 des Code vergleichbar ist, oder (d) einem Altersvorsorgeplan oder einem Plan unter einem Vergleichbaren Gesetz. Die Zertifikate wurden und werden nicht gemäß dem U.S.-amerikanischen *Securities Act* von 1933 in der jeweils geltenden Fassung (der "**Securities Act**") oder bei einer Wertpapieraufsichtsbehörde eines Einzelstaats oder einer anderen Gebietskörperschaft der Vereinigten Staaten registriert, der Emittent wurde und wird nicht als "Investmentgesellschaft" (*investment company*) gemäß dem U.S.-amerikanischen *Investment Company Act* von 1940 in der jeweils geltenden Fassung registriert (auf Grundlage von Section 3(c)(7) dieses Gesetzes) und es wurde und wird keine Person als Commodity Pool Operator des Emittenten gemäß dem U.S.-amerikanischen *Commodity Exchange Act* in der jeweils geltenden Fassung (der "**CEA**") und den Vorschriften der U.S.-amerikanischen Commodity Futures Trading Commission in deren Rahmen (die "**CFTC-Vorschriften**") registriert. Demzufolge dürfen die Zertifikate zu keinem Zeitpunkt angeboten, verkauft, verpfändet, weiterverkauft, geliefert oder anderweitig übertragen werden, es sei denn, dies erfolgt (a) im Rahmen einer Offshore-Transaktion (*offshore transaction*) (im Sinne von Regulation S des *Securities Act* ("**Regulation S**")) und (b) an Personen, die sowohl (1) "Nicht-U.S.-Personen" (*Non-United States person*) im Sinne der CFTC-Vorschrift 4.7(a)(1)(iv), im Sinne der Verordnung der Kommission (*Commission Regulation*) 23.160 und nach CFTC's Interpretive Guidance und Policy Statement Regarding Compliance mit bestimmten Swap Bestimmungen (*Interpretive Guidance und Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*), 78 Fed. Reg. 45292 (26. Juli 2013) sind, als auch (2) keine "U.S.-Personen" (*U.S. persons*) (im Sinne von Rule 902(k)(1) von Regulation S) sind (alle Personen, die unter die unmittelbar vorstehenden Punkte (1) und (2) fallen, werden als "**Zulässige Käufer**" bezeichnet). Erwirbt ein Zulässiger Käufer die Zertifikate für Rechnung oder zugunsten einer anderen Person, muss es sich bei dieser anderen Person ebenfalls um einen Zulässigen Käufer handeln. Die Zertifikate stellen keine Kontrakte über den Verkauf einer Ware zur künftigen Lieferung (*contracts of sale of a commodity for future delivery*) (oder Optionen darauf) nach Maßgabe des CEA dar bzw. wurden nicht als solche vertrieben, und der Handel mit den Zertifikaten wurde nicht von der U.S.-amerikanischen Commodity Futures Trading Commission im Rahmen des CEA zugelassen."

3. In den Basisprospekten im Punkt E.3 des "**Abschnitt E - Angebot**" auf den unter **Punkt 3** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die im letzten Absatz vor der Unterüberschrift "Ausgabepreis sowie Kosten und Steuern beim Erwerb" enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Die Optionsscheine dürfen insbesondere nicht von einem Plananleger oder von einem Plan, der Vergleichbarem Recht unterliegt, gekauft oder gehalten werden oder auf einen solchen übertragen werden, es sei denn, der Kauf oder das Halten der Optionsscheine, im Fall eines Plananlegers, führt nicht zu einer nicht ausgenommenen, verbotenen Transaktion gemäß Section 406 des U.S. Employee Retirement Income Security Act von 1974, in der jeweils geltenden Fassung ("**ERISA**") oder Section 4975 des U.S. Internal Revenue Code von 1986, in der jeweils geltenden Fassung (der "**Code**"), da dieser Erwerb und diese Beteiligung die Voraussetzung für eine Befreiung im Rahmen einer anwendbaren Ausnahme von verbotenen Transaktionen erfüllt, oder im Falle eines Plans, der einem Vergleichbaren Gesetz unterliegt, zu einem Verstoß gegen ein Vergleichbares Gesetz. Für die Zwecke dieses Abschnitts bezeichnet "**Plananleger**" (*benefit plan investor*) (a) einen Altersvorsorgeplan (*employee benefit plan*) (im Sinne von Section 3(3) Title I der ERISA), (b) einen Plan im Sinne und nach Maßgabe von Section 4975 des Code, (c) jeden Rechtsträger, der das Planvermögen eines solchen Altersvorsorgeplans oder Plans hält, und "**Vergleichbares Gesetz**" bezeichnet ein Gesetz, welches der treuhänderischen Verantwortung oder verbotenen Transaktionsbestimmung von ERISA oder Abschnitt 4975 des Code vergleichbar ist, oder (d) einem Altersvorsorgeplan oder einem Plan unter einem Vergleichbaren Gesetz. Die Optionsscheine wurden und werden nicht gemäß dem U.S.-amerikanischen *Securities Act* von 1933 in der jeweils geltenden Fassung (der "**Securities Act**") oder bei einer Wertpapieraufsichtsbehörde eines Einzelstaats oder einer anderen Gebietskörperschaft der Vereinigten Staaten registriert, der Emittent wurde und wird nicht als "Investmentgesellschaft" (*investment company*) gemäß dem U.S.-amerikanischen *Investment Company Act* von 1940 in der jeweils geltenden Fassung registriert (auf Grundlage von Section 3(c)(7) dieses Gesetzes) und es wurde und wird keine Person als Commodity Pool Operator des Emittenten gemäß dem U.S.-amerikanischen *Commodity Exchange Act* in der jeweils geltenden Fassung (der "**CEA**") und den Vorschriften der U.S.-amerikanischen Commodity Futures Trading Commission in deren Rahmen (die "**CFTC-Vorschriften**") registriert. Demzufolge dürfen die Optionsscheine zu keinem Zeitpunkt angeboten, verkauft, verpfändet, weiterverkauft, geliefert oder anderweitig übertragen werden, es sei denn, dies erfolgt (a) im Rahmen einer Offshore-Transaktion (*offshore transaction*) (im Sinne von Regulation S des *Securities Act* ("**Regulation S**")) und (b) an Personen, die sowohl (1) "Nicht-U.S.-Personen" (*Non-United States person*) im Sinne der CFTC-Vorschrift 4.7(a)(1)(iv), im Sinne der Verordnung der Kommission (*Commission Regulation*) 23.160 und nach CFTC's Interpretive Guidance und Policy Statement Regarding Compliance mit bestimmten Swap Bestimmungen (*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*), 78 Fed. Reg. 45292 (26. Juli 2013) sind, als auch (2) keine "U.S.-Personen" (*U.S. persons*) (im Sinne von Rule 902(k)(1) von Regulation S) sind (alle Personen, die unter die unmittelbar vorstehenden Punkte (1) und (2) fallen, werden als "**Zulässige Käufer**" bezeichnet). Erwirbt ein Zulässiger Käufer die Optionsscheine für Rechnung oder zugunsten einer anderen Person, muss es sich bei dieser anderen Person ebenfalls um einen Zulässigen Käufer handeln. Die Optionsscheine stellen keine Kontrakte über den Verkauf einer Ware zur künftigen Lieferung (*contracts of sale of a commodity for future delivery*) (oder Optionen darauf) nach Maßgabe des CEA dar bzw. wurden nicht als solche vertrieben, und der Handel mit den Optionsscheinen wurde nicht von der U.S.-amerikanischen Commodity Futures Trading Commission im Rahmen des CEA zugelassen."

Änderungen bezüglich des Abschnitts "V. Zertifikatsbedingungen"

4. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Zertifikatsbedingungen**" auf den unter **Punkt 4** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die in Nr. 3 Absatz (7) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Zusicherung durch Anleger: Von jedem Anleger, der Zertifikate kauft, gilt gegenüber dem Emittenten und, falls dieser nicht gleichzeitig der Verkäufer ist, gegenüber dem Verkäufer der betreffenden Wertpapiere die Zusicherung als abgegeben, dass (1) er keine U.S.-Person (im Sinne der Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Auslegungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

5. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Zertifikatsbedingungen**" auf den unter **Punkt 5** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die in Nr. 3 Absatz (8) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Zusicherung durch Anleger: Von jedem Anleger, der Zertifikate kauft, gilt gegenüber dem Emittenten und, falls dieser nicht gleichzeitig der Verkäufer ist, gegenüber dem Verkäufer der betreffenden Wertpapiere die Zusicherung als abgegeben, dass (1) er keine U.S.-Person (im Sinne der Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Auslegungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

6. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Zertifikatsbedingungen**" auf den unter **Punkt 6** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die in Nr. 3 Absatz (9) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Zusicherung durch Anleger: Von jedem Anleger, der Zertifikate kauft, gilt gegenüber dem Emittenten und, falls dieser nicht gleichzeitig der Verkäufer ist, gegenüber dem Verkäufer der betreffenden Wertpapiere die Zusicherung als abgegeben, dass (1) er keine U.S.-Person (im Sinne der

Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Auslegungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

7. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Zertifikatsbedingungen**" auf den unter **Punkt 7** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die im letzten Aufzählungspunkt in Nr. 3 Absatz (1) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Ferner ist zu bestätigen, dass (1) der Zertifikatsinhaber keine U.S.-Person (im Sinne der Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Auslegungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

Änderungen bezüglich des Abschnitts "V. Optionsscheinbedingungen"

8. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Optionsscheinbedingungen**" auf den unter **Punkt 8** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die in Nr. 3 I. Absatz (7) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Zusicherung durch Anleger: Von jedem Anleger, der Optionsscheine kauft, gilt gegenüber dem Emittenten und, falls dieser nicht gleichzeitig der Verkäufer ist, gegenüber dem Verkäufer der betreffenden Wertpapiere die Zusicherung als abgegeben, dass (1) er keine U.S.-Person (im Sinne der Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Aus-

legungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

9. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Optionsscheinbedingungen**" auf den unter **Punkt 9** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die in Nr. 3 Absatz (7) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Zusicherung durch Anleger: Von jedem Anleger, der Optionsscheine kauft, gilt gegenüber dem Emittenten und, falls dieser nicht gleichzeitig der Verkäufer ist, gegenüber dem Verkäufer der betreffenden Wertpapiere die Zusicherung als abgegeben, dass (1) er keine U.S.-Person (im Sinne der Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Auslegungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

10. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Optionsscheinbedingungen**" auf den unter **Punkt 10** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die im letzten Aufzählungspunkt in Nr. 3 II. Absatz (1) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Ferner ist zu bestätigen, dass (1) der Optionsscheininhaber keine U.S.-Person (im Sinne der Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Auslegungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

11. In den Basisprospekten im Abschnitt "**V. Optionsscheinbedingungen**" auf den unter **Punkt 11** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten werden die im letzten Aufzählungspunkt in Nr. 3 Absatz (1) enthaltenen Informationen gelöscht und durch folgende Informationen ersetzt:

"Ferner ist zu bestätigen, dass (1) der Optionsscheininhaber keine U.S.-Person (im Sinne der Definition in Regulation S sowie der CFTC Verordnung 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292, die "**Auslegungsleitlinien**") ist, (2) er auf Grundlage der maßgeblichen Leitlinien in den Auslegungsleitlinien einschließlich der

darin festgelegten Faktoren für Verbundene Zweckgesellschaften (*Affiliate Conduit Factors*) keine Verbundene Zweckgesellschaft (*Affiliate Conduit*) ist und (3) weder er noch von ihm geschuldete Verbindlichkeiten durch andere Garantien als Garantien von Personen, die nicht unter eine der Kategorien von U.S.-Personen (*U.S. Person Categories*) (wie in den Auslegungsleitlinien definiert) fallen und auch nicht anderweitig gemäß den Auslegungsleitlinien als "U.S.-Person" gelten würden, besichert werden."

Änderungen bezüglich des Abschnitts "IX. Verkaufsbeschränkungen"

12. In den Basisprospekten im Abschnitt "IX. Verkaufsbeschränkungen" auf den unter **Punkt 12** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten wird die Definition "Zulässiger Käufer" im dritten Absatz unter der Unterüberschrift "Vereinigte Staaten von Amerika" gelöscht und durch folgende Definition ersetzt:

"**Zulässiger Käufer**" bezeichnet jede Person, die:

- (a) keine "U.S.-Person" (*U.S. person*) im Sinne von Rule 902(k)(1) von Regulation S ist;
- (b) nicht für irgendwelche Zwecke unter eine Begriffsbestimmung von U.S.-Person im Rahmen des CEA oder einer Vorschrift, Richtlinie oder Weisung der CFTC, die im Rahmen des CEA vorgeschlagen oder veröffentlicht wurde, fällt (zur Klarstellung: jede Person, die keine "Nicht-U.S.-Person" (*Non-United States person*) im Sinne der CFTC-Vorschrift 4.7(a)(1)(iv), im Sinne der Verordnung der Kommission (*Commission Regulation*) 23.160 und der von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC (78 Fed. Reg. 45292) ist, gilt als U.S.-Person); und
- (c) keine "U.S.-Person" (*United States person*) im Sinne von Section 7701(a)(30) des IRC ist."

13. In den Basisprospekten im Abschnitt "IX. Verkaufsbeschränkungen" auf den unter **Punkt 13** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten wird der Inhalt des Hinweises, dass jede Globalurkunde zur Verbriefung einer Serie von Wertpapieren einen Hinweis enthält (in Fettdruck dargestellt), gelöscht und durch folgende Angaben ersetzt:

"DIE DURCH DIESE GLOBALURKUNDE VERBRIEFTE WERTPAPIERE WURDEN UND WERDEN NICHT GEMÄSS DEM U.S.-AMERIKANISCHEN *SECURITIES ACT* VON 1933 IN DER JEWEILS GELTENDEN FASSUNG (DER "**SECURITIES ACT**") ODER BEI EINER WERTPAPIERAUFSICHTSBEHÖRDE EINES EINZELSTAATS ODER EINER ANDEREN GEBIETSKÖRPERSCHAFT DER VEREINIGTEN STAATEN REGISTRIERT UND ES WURDE UND WIRD KEINE PERSON ALS COMMODITY POOL OPERATOR DES EMITTENTEN ODER COMMODITY TRADING ADVISOR GEMÄSS DEM U.S.-AMERIKANISCHEN *COMMODITY EXCHANGE ACT* VON 1936 IN DER JEWEILS GELTENDEN FASSUNG (DER "**CEA**") UND DEN VORSCHRIFTEN DER U.S.-AMERIKANISCHEN COMMODITY FUTURES TRADING COMMISSION ("**CFTC**") IN DEREN RAHMEN (DIE "**CFTC-VORSCHRIFTEN**") REGISTRIERT. FERNER WURDE UND WIRD DER EMITTENT NICHT ALS "INVESTMENTGESELLSCHAFT" (*INVESTMENT*

COMPANY) GEMÄSS DEM U.S.-AMERIKANISCHEN *INVESTMENT COMPANY ACT* VON 1940 IN DER JEWEILS GELTENDEN FASSUNG REGISTRIERT.

DEMFOLGE DÜRFEN DIE DURCH DIESE GLOBALRUKUNDE VERBRIEFTE WERTPAPIERE ZU KEINEM ZEITPUNKT ANGEBOUEN, VERKAUFT, VERPFÄNDET, WEITERVERKAUFT, GELIEFERT ODER ANDERWEITIG ÜBERTRAGEN WERDEN, ES SEI DENN, DIES ERFOLGT NACH MASSGABE DES FOLGENDEN SATZES. DURCH SEINEN ERWERB EINES WERTPAPIERS ODER VON WIRTSCHAFTLICHEM EIGENTUM DARAN:

- (1) SICHERT DER ERWERBER ZU, DASS
 - (A) ER DAS WERTPAPIER BZW. DAS WIRTSCHAFTLICHE EIGENTUM DARIN IM RAHMEN EINER OFFSHORE-TRANSAKTION (*OFFSHORE TRANSACTION*) (IM SINNE VON REGULATION S DES SECURITIES ACT ("**REGULATION S**")) ERWORBEN HAT,
 - (B) ER KEINE "U.S.-PERSON" (*U.S. PERSON*) IM SINNE VON RULE 902(k)(1) VON REGULATION S IST; NICHT FÜR IRGENDWELCHE ZWECHE UNTER EINE DER BEGRIFFSBESTIMMUNGEN VON U.S.-PERSON IM RAHMEN DES CEA ODER EINER VORSCHRIFT, RICHTLINIE ODER WEISUNG DER CFTC, DIE VON DER CFTC IM RAHMEN DES CEA VORGESCHLAGEN ODER VERÖFFENTLICHT WURDE, FÄLLT (ZUR KLARSTELLUNG: JEDE PERSON, DIE KEINE "NICHT-U.S.-PERSON" (*NON-UNITED STATES PERSON*) IM SINNE DER CFTC-VORSCHRIFT 4.7(a)(1)(iv), IM SINNE DER VERORDNUNG DER KOMMISSION (*COMMISSION REGULATION*) 23.160 UND DEN VON DER CFTC AM 26. JULI 2013 VERÖFFENTLICHTEN "INTERPRETIVE GUIDANCE AND POLICY STATEMENT REGARDING COMPLIANCE WITH CERTAIN SWAP REGULATIONS" DER CFTC (78 FED. REG. 45292) IST, GILT ALS U.S.-PERSON); UND ER KEINE "U.S.-PERSON" IM SINNE VON SECTION 7701 (a) (30) DES U.S. INTERNAL REVENUE CODE VON 1986, IN DER JEWEILS GELTENDEN FASSUNG (DER "**CODE**") IST (JEDE PERSON, DIE UNTER DIESE KLAUSEL (B) FÄLLT, EIN "**ZULÄSSIGER KÄUFER**");
 - (C) (1) ER (I) KEIN ALTERSVORSORGEPLAN (*EMPLOYEE BENEFIT PLAN*), WIE IN SECTION 3 (3) DES U.S. EMPLOYEE RETIREMENT INCOME SECURITY ACT VON 1974, IN DER JEWEILS GELTENDEN FASSUNG ("**ERISA**"), BESCHRIEBEN, IST ODER SEIN WIRD, DER DEN BESTIMMUNGEN VON TITEL I VON ERISA UNTERLIEGT, (II) KEIN PLAN IST ODER SEIN WIRD, DER IN SECTION 4975 (e) (1) DES CODE BESCHRIEBEN IST, UND DER SECTION 4975 DES CODE UNTERLIEGT, (III) KEIN RECHTSTRÄGER IST ODER SEIN WIRD, DESSEN VERMÖGENSWERTE ALS VERMÖGENSWERTE EINES DER VORSTEHENDEN BEHANDELT WERDEN (JEDER DER (I), (II), UND (III) WIRD ALS "PLANANLEGER" BEZEICHNET) ODER (IV) KEIN PLAN IST ODER SEIN WIRD, DER EINEM GESETZ UNTERLIEGT, DAS DEN BESTIMMUNGEN ZUR TREUHÄNDERISCHEN VERANTWORTUNG ODER ZU VERBOTENEN TRANSAKTIONEN UNTER ERISA ODER SECTION 4975 DES CODE VERGLEICHBAR IST ("**VERGLEICHBARES GESETZ**"), ODER (2) DER

ERWERB UND BESITZ DER WERTPAPIERE NICHT, IM FALL EINES PLANANLEGERES, ZU EINER NICHT AUSGENOMMENEN VERBOTENEN TRANSAKTION GEMÄSS SECTION 406 ERISA, SECTION 4975 DES CODE FÜHRT, DA DIESER ERWERB UND DIESE BETEILIGUNG DIE VORAUSSETZUNG FÜR EINE BEFREIUNG IM RAHMEN EINER ANWENDBAREN AUSNAHME VON VERBOTENEN TRANSAKTIONEN ERFÜLLT, ODER, IM FALLE EINES PLANS, DER EINEM VERGLEICHBAREM GESETZ UNTERLIEGT, ZU EINEM VERSTOSS GEGEN EIN VERGLEICHBARES GESETZ FÜHRT; UND

- (D) FALLS ER DAS WERTPAPIER BZW. DAS WIRTSCHAFTLICHE EIGENTUM DARAN FÜR RECHNUNG ODER ZUGUNSTEN EINER ANDEREN PERSON ERWIRBT, ES SICH BEI DIESER ANDEREN PERSON EBENFALLS UM EINEN ZULÄSSIGEN KÄUFER HANDELT;
- (2) VERPFLICHTET SICH DER ERWERBER GEGENÜBER DEM EMITTENTEN DAZU, WÄHREND DER LAUFZEIT DER WERTPAPIERE ANGEBOTE, VERKÄUFE, VERPFÄNDUNGEN ODER ANDERWEITIGE ÜBERTRAGUNGEN VON WERTPAPIEREN BZW. WIRTSCHAFTLICHEM EIGENTUM DARAN AUSSCHLIESSLICH AN EINEN ZULÄSSIGEN KÄUFER, DER FÜR EIGENE RECHNUNG ODER FÜR RECHNUNG UND ZUGUNSTEN EINES ANDEREN ZULÄSSIGEN KÄUFERS HANDELT, UND AUSSCHLIESSLICH IM RAHMEN EINER OFFSHORE-TRANSAKTION (WIE VORSTEHEND DEFINIERT) VORZUNEHMEN, UND BESTÄTIGT, DASS DER EMITTENT BERECHTIGT IST, DIE ANERKENNUNG DER ÜBERTRAGUNG EINES WERTPAPIERS ODER VON WIRTSCHAFTLICHEM EIGENTUM UNTER VERSTOSS GEGEN DIE VORSTEHENDEN BESTIMMUNGEN ZU VERWEIGERN;
- (3) BESTÄTIGT DER ERWERBER, DASS DER EMITTENT FÜR DEN FALL, DASS DER ERWERBER ZU EINEM BELIEBIGEN ZEITPUNKT KEIN ZULÄSSIGER KÄUFER MEHR IST, BERECHTIGT IST, (A) DEN ERWERBER ZUM VERKAUF DES WERTPAPIERS BZW. DES WIRTSCHAFTLICHEN EIGENTUMS DARAN AN EINE PERSON, BEI DER ES SICH UM EINEN ZULÄSSIGEN KÄUFER HANDELT, ZU ZWINGEN ODER (B) DEN WIRTSCHAFTLICHEN EIGENTÜMER ZUR ÜBERTRAGUNG DES WERTPAPIERS BZW. DES WIRTSCHAFTLICHEN EIGENTUMS DARAN AUF DEN EMITTENTEN UND, FALLS DIESER NICHT GLEICHZEITIG DER VERKÄUFER IST, AUF DEN VERKÄUFER DER WERTPAPIERE ZU ZWINGEN, JEWEILS ZUM NIEDRIGEREN DER FOLGENDEN PREISE: (X) VOM WIRTSCHAFTLICHEN EIGENTÜMER FÜR DIE WERTPAPIERE GEZAHLTER KAUFPREIS, (Y) 100 % DES NENNBETRAGS DER WERTPAPIERE UND (Z) ANGEMESSENER MARKTWERT DER WERTPAPIERE UND
- (4) BESTÄTIGT DER ERWERBER, DASS DER EMITTENT BERECHTIGT IST, VON JEDEM WIRTSCHAFTLICHEN EIGENTÜMER VON WERTPAPIEREN IN REGELMÄSSIGEN ABSTÄNDEN EINE BESCHEINIGUNG DARÜBER ZU VERLANGEN, DASS ES SICH BEI DEM BETREFFENDEN WIRTSCHAFTLICHEN EIGENTÜMER UM EINEN ZULÄSSIGEN KÄUFER HANDELT."

Änderungen bezüglich des Abschnitts "X. Hinweis an die Anleger"

14. In den Basisprospekten im Abschnitt "X. Hinweis an die Anleger" auf den unter **Punkt 14** in der untenstehenden **Tabelle** genannten Seiten wird die unter Buchstabe (c) enthaltene Bestätigung gelöscht und durch folgende Bestätigung ersetzt:

"Sie sind keine "U.S.-Person" (*U.S. person*) (im Sinne von Rule 902(k)(1) von Regulation S); Sie fallen nicht für irgendwelche Zwecke unter eine der Begriffsbestimmungen von U.S.-Person im Rahmen des CEA oder einer Vorschrift, Richtlinie oder Weisung der CFTC, die von der CFTC im Rahmen des CEA vorgeschlagen oder veröffentlicht wurde (zur Klarstellung: jede Person, die keine "Nicht-U.S.-Person" (*Non-United States person*) im Sinne der CFTC-Vorschrift 4.7(a)(1)(iv), im Sinne der Verordnung der Kommission (*Commission Regulation*) 23.160 und den von der CFTC am 26. Juli 2013 veröffentlichten "*Interpretive Guidance and Policy Statement Regarding Compliance with Certain Swap Regulations*" der CFTC ist, gilt als U.S.-Person); und sie sind keine "U.S.-Person" im Sinne von Section 7701 (a) (30) des Code (jede Person, die unter diese Klausel (c) fällt, ein "**Zulässiger Käufer**");"

Nr.	Bezeichnung	Nachtrag Nr.	Datum des Basisprospekts	Punkt 1	Punkt 2	Punkt 3	Punkt 4	Punkt 5
1	Basisprospekt für die Begebung, Aufstockung, Wiederaufnahme des Angebots oder die Fortsetzung des öffentlichen Angebots von Zertifikaten bezogen auf Aktien bzw. aktienvertretende Wertpapiere, Aktienindizes, Wechselkurse, Rohstoffe, Fonds, Exchange Traded Funds, Futures-Kontrakte oder einen Korb bestehend aus Aktien bzw. aktienvertretenden Wertpapieren, Aktienindizes, Wechselkursen, Rohstoffen, Fonds, Exchange Traded Funds, Futures-Kontrakten	2	5. Juni 2019	2f.	47f.	Nicht anwendbar ("n.a.")	192	167
2	Basisprospekt für die Begebung, Aufstockung, Wiederaufnahme des Angebots oder die Fortsetzung des öffentlichen Angebots von Optionsscheinen bezogen auf Aktien bzw. aktienvertretende Wertpapiere, Aktienindizes, Wechselkurse, Rohstoffe, Fonds, Exchange Traded Funds, Futures-Kontrakte	2	5. Juni 2019	2f.	n.a.	42f.	n.a.	n.a.

Nr.	Punkt 6	Punkt 7	Punkt 8	Punkt 9	Punkt 10	Punkt 11	Punkt 12	Punkt 13	Punkt 14
1	138, 144, 151, 156, 163, 172, 176, 188, 204	180, 196f.	n.a.	n.a.	n.a.	n.a.	274	277ff.	282
2	n.a.	n.a.	123f., 130, 162	150, 154, 157	125, 131, 163	138, 146	225	228ff.	233