

Citigroup Global Markets Deutschland AG

Frankfurt am Main

Ausschließlich zur Verbreitung in der Bundesrepublik Deutschland

Endgültige Angebotsbedingungen

- Nr. N003970 vom 16.07.2010-

zum Basisprospekt Nr. 5 vom 13.07.2010

für

Open End Turbo Stopp-Loss Optionsscheine mit Knock-Out und Gap-Risiko

(Mini Future Optionsscheine)

bezogen auf folgende Basiswerte:

Adobe, Advanced Micro Devices, AIG, Akamai, Altria Group, Amazon.com, Apple Computer, AT&T, BAIDU.COM, Bank of America, Caterpillar, Chesapeake, Cisco Systems, Cognizant, ConocoPhillips, Deutsche Bank, eBay, Electronic Arts, EMC, General Electric, Goldman Sachs, Google, Hartford Financial Services, Hewlett-Packard, IBM, Intel, Juniper Networks, Lanxess, Marvell Technology, Micron Technology, Monsanto, Motorola, NetApp, Oracle, Pfizer, Qualcomm, Rambus, Research in Motion, RWE, Salesforce.com, SanDisk, Scientific Games, Sohu, Starbucks, SunPower, Suntech Power, Symantec, Tessera, Texas Instruments, Trina Solar, Vale

ISIN:

DE000CG9TKC5 - DE000CG9TKZ6

DE000CG9TLA7 - DE000CG9TLZ4

DE000CG9TMA5 - DE000CG9TMZ2

DE000CG9TNA3 - DE000CG9TNL0

Wichtiger Hinweis:

Die vollständigen Informationen über den Emittenten und das Angebot der Wertpapiere sind für den Leser nur verfügbar, wenn der Basisprospekt in seiner jeweils aktuellen Fassung und diese endgültigen Angebotsbedingungen Nr. N003970 vom 16.07.2010 zusammen genommen werden. Der Basisprospekt in seiner jeweils aktuellen Fassung bildet zusammen mit diesen endgültigen Angebotsbedingungen Nr. N003970 vom 16.07.2010 den vollständigen Wertpapier-Prospekt.

Der Basisprospekt in seiner jeweils aktuellen Fassung ist wie folgt kostenlos erhältlich:

(1) Papierversionen werden zur kostenlosen Ausgabe bereitgehalten bei:	Citigroup Global Markets Deutschland AG New Issues Structuring Frankfurter Welle Reuterweg 16 60323 Frankfurt am Main
(2) Auf der Internetseite der Emittentin unter:	http://www.citifirst.com

Inhaltsverzeichnis

Titelblatt:	Seite	1
Wichtiger Hinweis:	Seite	2
Inhaltsverzeichnis:	Seite	3
Verkaufsbeschränkungen:	Seite	4
Zusammenfassung ausgewählter Angebotsbedingungen:	Seite	6
Optionsbedingungen:	Seite	7
Andere endgültige Angebotsbedingungen, die den Teil "E. Beschreibung der Wertpapiere" des Basisprospekts ergänzen:	Seite	29

Verkaufsbeschränkungen

1. Eine Registrierung der Optionsscheine nach dem "United States Securities Act" von 1933 wird nicht vorgenommen; die Optionsscheine werden nicht zum Handel an einer US-Börse oder dem "Board of Trade" oder in sonstiger Weise durch die "Commodity Futures Trading Commission" ("CFTC") gemäß "United States Commodity Exchange Act" zugelassen. Der Emittent ist nicht bei der CFTC als Makler ("Commission Merchant") registriert. Mit Kauf und Annahme der Optionsscheine versichert der Optionsscheininhaber, dass er keine United States Person wie nachstehend definiert ist und dass er, sollte er in Zukunft unter die Definition einer United States Person fallen, die Optionsscheine noch vorher verkaufen wird; der Optionsscheininhaber sichert weiterhin zu, dass er die Optionsscheine zu keinem Zeitpunkt in den Vereinigten Staaten direkt oder indirekt angeboten, verkauft oder gehandelt hat und dies auch in Zukunft nicht tun wird; der Optionsscheininhaber sichert außerdem zu, (a) dass er die Optionsscheine zu keinem Zeitpunkt einer United States Person direkt oder indirekt angeboten, verkauft oder mit einer solchen gehandelt hat und dass er dies auch in Zukunft (weder für sich noch für Dritte) tun wird und (b) dass er die Optionsscheine nicht auf Rechnung einer United States Person gekauft hat. Der Optionsscheininhaber verpflichtet sich, bei einem Verkauf der Optionsscheine dem Käufer diese Verkaufsbeschränkungen - einschließlich nachfolgender Definitionen - auszuhändigen oder den Käufer auf diese Verkaufsbeschränkungen schriftlich hinzuweisen.

Es gelten folgende Definitionen: "Vereinigte Staaten" bedeutet die Vereinigten Staaten von Amerika (einschließlich deren Staaten, des "District of Columbia", sowie der Territorien, Besitzungen und sonstigen Gebiete unter deren Jurisdiktion); "United States Person" bedeutet Bürger oder Gebietsansässige der Vereinigten Staaten von Amerika sowie Kapital- und Personengesellschaften oder sonstige nach dem Recht der Vereinigten Staaten von Amerika oder einer ihrer Gebietskörperschaften begründete oder organisierte Gesellschaften sowie Erbschafts- oder Treuhandvermögen, die unabhängig von der Quelle ihrer Einkünfte der Besteuerung der Vereinigten Staaten von Amerika unterliegen.

2. Bei jeder Tätigkeit im Zusammenhang mit Citi Optionsscheinen/Zertifikaten oder anderen derivaten Produkten im Vereinigten Königreich müssen alle anwendbaren Bestimmungen des "Financial Services and Markets Act 2000 (nachfolgend "FSMA")" beachtet werden. Jede Verbreitung von Angeboten oder von Anreizen zur Aufnahme einer Investment Aktivität i.S.v. Paragraph 21 der FSMA darf im Zusammenhang mit der Emission oder dem Verkauf von Optionsscheinen/Zertifikaten oder anderen derivativen Produkten nur in solchen Fällen vorgenommen oder veranlasst werden, in denen Paragraph 21 der FSMA nicht anwendbar ist. In Bezug auf Wertpapiere mit einer Laufzeit von weniger als einem Jahr ist zudem Folgendes zu beachten: (i) die Wertpapiere dürfen nur von Personen verkauft werden, deren gewöhnliche Geschäftstätigkeit darin besteht, im Rahmen ihres Geschäftszwecks Anlagen zu erwerben, zu halten, zu verwalten oder zu veräußern (als Auftraggeber oder Beauftragter), und (ii) diese Personen haben keine Wertpapiere angeboten oder verkauft und werden keine Wertpapiere anbieten oder verkaufen, außer an Personen, deren gewöhnliche Geschäftstätigkeit darin besteht, im Rahmen ihres Geschäftszwecks Anlagen zu erwerben, zu halten, zu verwalten oder zu veräußern (als Auftraggeber oder Beauftragter), da die Begebung der Wertpapiere andernfalls einen Verstoß der Emittentin gegen Paragraph 19 des FSMA darstellen würde.
3. In Bezug auf jeden Mitgliedstaat des Europäischen Wirtschaftsraums, der die Prospektrichtlinie umgesetzt hat (jeweils ein "Betreffender Mitgliedstaat"), wurde bzw. wird für die Optionsscheine ab einschließlich dem Tag der Umsetzung der Prospektrichtlinie in diesem Betreffenden Mitgliedstaat (der "Betreffende Umsetzungstag") kein öffentliches Angebot unterbreitet. Unter folgenden Bedingungen können die Optionsscheine jedoch ab einschließlich dem Betreffenden Umsetzungstag in dem Betreffenden Mitgliedstaat öffentlich angeboten werden:

(a) in dem Zeitraum ab dem Tag der Veröffentlichung dieses Basisprospekts in Bezug auf diese Optionsscheine, der von den zuständigen Behörden dieses betreffenden Mitgliedstaats gebilligt wurde bzw. in einem anderen betreffenden Mitgliedstaat gebilligt und die zuständige Behörde in diesem betreffenden Mitgliedstaat unterrichtet wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Prospektrichtlinie, bis zu dem Tag, der 12 Monate nach dem Tag der Veröffentlichung liegt;

(b) an juristische Personen, die in Bezug auf ihre Tätigkeit auf den Finanzmärkten zugelassen sind bzw. beaufsichtigt werden, oder, falls sie nicht zugelassen sind oder beaufsichtigt werden, deren einziger Geschäftszweck in der Wertpapieranlage besteht;

(c) an juristische Personen, die laut ihrem letzten Jahresabschluss bzw. konsolidierten Jahresabschluss mindestens zwei der nachfolgenden Kriterien erfüllen: (1) eine durchschnittliche Beschäftigtenzahl im letzten Geschäftsjahr von mindestens 250, (2) eine Gesamtbilanzsumme von über EUR 43.000.000 und (3) ein Jahresnettoumsatz von über EUR 50.000.000;

(d) sofern sich das Angebot an weniger als 100 natürliche oder juristische Personen in diesem betreffenden Mitgliedstaat richtet, bei denen es sich nicht um qualifizierte Anleger im Sinne des Artikels 2 der Prospektrichtlinie handelt; oder

(e) unter anderen Umständen, die eine Veröffentlichung eines Prospekts durch den Emittenten gemäß Artikel 3 der Prospektrichtlinie nicht erfordern,

Für die Zwecke dieser Vorschrift bezeichnet der Ausdruck "öffentliches Angebot von Wertpapieren" (wie ggf. durch Maßnahmen im betreffenden Mitgliedstaat zur Umsetzung der Prospektrichtlinie in diesem betreffenden Mitgliedstaat geändert) in Bezug auf Wertpapiere in einem betreffenden Mitgliedstaat eine Mitteilung in jedweder Form und auf jedwede Art und Weise, die ausreichende Informationen über die Angebotsbedingungen und die anzubietenden Wertpapiere enthält, um einen Anleger in die Lage zu versetzen, sich für den Kauf oder die Zeichnung dieser Wertpapiere zu entscheiden; "Prospektrichtlinie" bezeichnet die Richtlinie 2003/71/EG und umfasst die jeweiligen Umsetzungsmaßnahmen in dem betreffenden Mitgliedstaat.

4. Bei jeder Tätigkeit im Zusammenhang mit den Optionsscheinen, insbesondere deren Erwerb oder Verkauf bzw. der Einlösung der Optionsrechte aus den Optionsscheinen sind durch die Optionsscheininhaber sowie jeden anderen beteiligten Marktteilnehmer die in dem jeweiligen Land geltenden gesetzlichen Bestimmungen zu beachten. Üblicherweise darf ein öffentliches Angebot der Optionsscheine nur erfolgen, wenn zuvor ein den gesetzlichen Bestimmungen des Landes, in dem das öffentliche Angebot erfolgt, entsprechender Verkaufsprospekt bzw. Börsenprospekt von der zuständigen Behörde genehmigt und veröffentlicht wurde. Die Veröffentlichung muss üblicherweise durch die Person erfolgen, die ein entsprechendes Angebot in der betreffenden Jurisdiktion unterbreitet. Optionsscheininhaber bzw. an einem Erwerb interessierte Personen sind daher gehalten, sich über die diesbezüglichen gesetzlichen Bestimmungen jederzeit zu informieren und sie zu beachten.

Zusammenfassung ausgewählter Angebotsbedingungen

Die nachfolgende Zusammenfassung stellt lediglich eine unverbindliche Auswahl einzelner Angebotsbedingungen dar. Rechtlich verbindlich sind ausschließlich die in diesen Endgültigen Angebotsbedingungen enthaltenen Optionsbedingungen.

Emittent:	Citigroup Global Markets Deutschland AG, Frankfurt am Main
Tag des ersten Angebots:	<u>19.07.2010</u>
Art des Angebots:	Öffentliches Angebot in Deutschland
Tag der anfänglichen Valutierung:	<u>21.07.2010</u>
Art der Wertpapiere:	Open End Turbo Stopp-Loss (Mini Future) Optionsscheine mit Knock-Out und Gap-Risiko
Auszahlungsbetrag:	Der Auszahlungsbetrag ist entweder der innere Wert, sofern dieser bereits in Euro ausgedrückt ist, oder der mit dem Referenzkurs der Währungsumrechnung in die Auszahlungswährung Euro umgerechnete innere Wert. Der innere Wert ist, vorbehaltlich einer Anpassung der Ausstattungsmerkmale der Optionsscheine, die in der Referenzwährung ausgedrückte und mit dem Bezugsverhältnis multiplizierte Differenz, um die der am Berechnungstag festgestellte Referenzkurs des Basiswerts den jeweiligen Basispreis überschreitet (Mini Long) bzw. unterschreitet (Mini Short).
Knock-Out Ereignis:	Falls der Beobachtungskurs des Basiswerts (unter Ausschluss von Kursen, die auf Grundlage der untertägigen Mittagsauktion oder einer anderen untertägigen Auktion berechnet werden), ausgedrückt in der Referenzwährung, während des Beobachtungszeitraums innerhalb der Beobachtungsstunden zu irgendeinem Zeitpunkt (nachfolgend der "Knock-Out Zeitpunkt" genannt) der Knock-Out Schwelle des Optionsscheins entspricht oder diese unterschreitet (Mini Long) bzw. entspricht oder diese überschreitet (Mini Short) (das "Knock-Out Ereignis"), endet die Laufzeit der Optionsscheine mit dem Knock-Out Zeitpunkt vorzeitig. Sofern der Stopp-Loss-Auszahlungsbetrag gemäß Nr. 2a (2) positiv ist, erhält der Optionsscheininhaber den Stopp-Loss-Auszahlungsbetrag.
Kündigung durch den Emittenten:	Der Emittent ist berechtigt sämtliche Optionsscheine einer Serie mit einer Ankündigungsfrist von 4 Wochen zu kündigen, jedoch nicht vor einem in den Optionsbedingungen bestimmten Zeitpunkt.
Abrechnungsart:	Barabrechnung
Einlösung:	Die Optionsscheine können durch den Optionsscheininhaber monatlich nur mit Wirkung zu einem in den Optionsbedingungen festgelegten Tag eingelöst werden.
Listing:	Stuttgart: Regulierter Markt (EUWAX Regulated); Frankfurt: Scoach SmartTrading im Freiverkehr.
Delisting:	Die Optionsscheine werden am Delisting-Tag von jeder Börse, an der sie gelistet waren, aus dem Handel genommen. Delisting-Tag ist entweder (i) der erste Geschäftstag nach dem Knock-Out Zeitpunkt, im Falle, dass die Laufzeit der Optionsscheine gemäß Nr. 2a (1) der Optionsbedingungen vorzeitig endet oder (ii) der Geschäftstag nach dem Tag des Wirksamwerdens einer Kündigung durch den Emittenten gemäß Nr. 9 oder Nr. 9a der Optionsbedingungen.
Minimale Handelsmenge:	1 Optionsschein oder ein ganzzahliges Vielfaches hiervon.
Minimale Einlösungsmenge:	1 Optionsschein je ISIN oder ein ganzzahliges Vielfaches hiervon.
Angebots- oder Handelswährung:	Euro (die Wertpapiere werden in Euro angeboten und gehandelt)
Clearing:	Miteigentumsanteile an einem bei der Clearstream Banking AG Frankfurt am Main hinterlegten Inhaber-Sammeloptionsschein.

Bei den folgenden Optionsbedingungen sind die Platzhalter („#“) der im Basisprospekt enthaltenen Optionsbedingungen mit den jeweiligen Daten ausgefüllt.
Zur genauen Erkennbarkeit der Endgültigen Angebotsbedingungen sind die die Platzhalter ausfüllenden Bedingungen unterstrichen dargestellt.

Optionsbedingungen

Mini Future Optionsscheine bezogen auf Aktien

Tabelle 1:

WKN	ISIN	Basiswert	Art	Basispreis am Tag des ersten Angebots	Knock-Out Schwelle im 1. Anpassungszeitraum	Anpassungsprozensatz im 1. Anpassungszeitraum	Bezugsverhältnis	Beginn der Laufzeit	Anzahl
CG9TKC	DE000CG9TKC5	Deutsche Bank	Mini Short	EUR 52,00	EUR 50,00	-3,40%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKD	DE000CG9TKD3	Lanxess	Mini Short	EUR 42,00	EUR 40,00	-3,40%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKE	DE000CG9TKE1	RWE	Mini Short	EUR 59,00	EUR 56,00	-3,40%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKF	DE000CG9TKF8	Adobe	Mini Long	USD 23,00	USD 25,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKG	DE000CG9TKG6	Adobe	Mini Long	USD 24,00	USD 26,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKH	DE000CG9TKH4	Adobe	Mini Short	USD 32,00	USD 30,00	-3,66%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKJ	DE000CG9TKJ0	Advanced Micro Devices	Mini Long	USD 6,50	USD 7,00	4,34%	0,5	19.07.2010	5.000.000
CG9TKK	DE000CG9TKK8	AIG	Mini Long	USD 32,00	USD 34,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKL	DE000CG9TKL6	AIG	Mini Long	USD 33,00	USD 35,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKM	DE000CG9TKM4	Akamai	Mini Long	USD 39,00	USD 40,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKN	DE000CG9TKN2	Altria Group	Mini Long	USD 19,00	USD 20,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKP	DE000CG9TKP7	Altria Group	Mini Short	USD 25,00	USD 24,00	-3,66%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKQ	DE000CG9TKQ5	Altria Group	Mini Short	USD 27,00	USD 26,00	-3,66%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKR	DE000CG9TKR3	Amazon.com	Mini Long	USD 98,00	USD 105,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKS	DE000CG9TKS1	Amazon.com	Mini Long	USD 103,00	USD 110,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKT	DE000CG9TKT9	Amazon.com	Mini Long	USD 108,00	USD 115,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKU	DE000CG9TKU7	Apple Computer	Mini Short	USD 290,00	USD 280,00	-3,66%	0,05	19.07.2010	5.000.000
CG9TKV	DE000CG9TKV5	AT&T	Mini Short	USD 31,50	USD 30,00	-3,66%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKW	DE000CG9TKW3	BAIDU.COM	Mini Long	USD 38,00	USD 60,00	4,34%	0,05	19.07.2010	5.000.000
CG9TKX	DE000CG9TKX1	BAIDU.COM	Mini Long	USD 48,00	USD 70,00	4,34%	0,05	19.07.2010	5.000.000
CG9TKY	DE000CG9TKY9	Bank of America	Mini Long	USD 13,00	USD 14,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TKZ	DE000CG9TKZ6	Caterpillar	Mini Long	USD 57,00	USD 60,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLA	DE000CG9TLA7	Chesapeake	Mini Short	USD 25,50	USD 24,00	-3,66%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLB	DE000CG9TLB5	Cisco Systems	Mini Long	USD 21,00	USD 22,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLC	DE000CG9TLC3	Cognizant	Mini Long	USD 47,50	USD 50,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLD	DE000CG9TLD1	ConocoPhillips	Mini Long	USD 47,50	USD 50,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLE	DE000CG9TLE9	eBay	Mini Long	USD 18,00	USD 19,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLF	DE000CG9TLF6	Electronic Arts	Mini Long	USD 13,00	USD 14,00	4,34%	0,1	19.07.2010	5.000.000

CG9TLG	DE000CG9TLG4	EMC	Mini Long	USD	17.00	USD	18.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLH	DE000CG9TLH2	EMC	Mini Long	USD	18.00	USD	19.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLJ	DE000CG9TLJ8	General Electric	Mini Long	USD	13.00	USD	14.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLK	DE000CG9TLK6	Goldman Sachs	Mini Long	USD	121.00	USD	130.00	4.34%	0.05	19.07.2010	5.000.000
CG9TLL	DE000CG9TLL4	Goldman Sachs	Mini Long	USD	126.00	USD	135.00	4.34%	0.05	19.07.2010	5.000.000
CG9TLM	DE000CG9TLM2	Google	Mini Long	USD	421.00	USD	450.00	4.34%	0.05	19.07.2010	5.000.000
CG9TLN	DE000CG9TLN0	Hartford Financial Services	Mini Long	USD	17.50	USD	19.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLP	DE000CG9TLP5	Hartford Financial Services	Mini Short	USD	25.50	USD	24.00	-3.66%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLQ	DE000CG9TLQ3	Hartford Financial Services	Mini Short	USD	26.50	USD	25.00	-3.66%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLR	DE000CG9TLR1	Hewlett-Packard	Mini Long	USD	42.50	USD	45.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLS	DE000CG9TLS9	IBM	Mini Long	USD	114.00	USD	120.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLT	DE000CG9TLT7	Intel	Mini Long	USD	18.00	USD	19.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLU	DE000CG9TLU5	Intel	Mini Long	USD	19.00	USD	20.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLV	DE000CG9TLV3	Juniper Networks	Mini Long	USD	22.50	USD	24.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLW	DE000CG9TLW1	Juniper Networks	Mini Long	USD	23.50	USD	25.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLX	DE000CG9TLX9	Marvell Technology	Mini Long	USD	15.00	USD	16.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TLY	DE000CG9TLY7	Micron Technology	Mini Long	USD	7.50	USD	8.00	4.34%	0.5	19.07.2010	5.000.000
CG9TLZ	DE000CG9TLZ4	Monsanto	Mini Long	USD	41.00	USD	45.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMA	DE000CG9TMA5	Monsanto	Mini Long	USD	46.00	USD	50.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMB	DE000CG9TMB3	Motorola	Mini Long	USD	6.00	USD	6.50	4.34%	0.5	19.07.2010	5.000.000
CG9TMC	DE000CG9TMC1	Motorola	Mini Long	USD	6.50	USD	7.00	4.34%	0.5	19.07.2010	5.000.000
CG9TMD	DE000CG9TMD9	NetApp	Mini Long	USD	36.50	USD	38.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TME	DE000CG9TME7	Oracle	Mini Long	USD	21.00	USD	22.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMF	DE000CG9TMF4	Pfizer	Mini Long	USD	13.00	USD	14.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMG	DE000CG9TMG2	Qualcomm	Mini Long	USD	29.50	USD	32.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMH	DE000CG9TMH0	Qualcomm	Mini Long	USD	31.50	USD	34.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMJ	DE000CG9TMJ6	Qualcomm	Mini Long	USD	32.50	USD	35.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMK	DE000CG9TMK4	Rambus	Mini Long	USD	16.00	USD	17.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TML	DE000CG9TML2	Research in Motion	Mini Long	USD	47.00	USD	50.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMM	DE000CG9TMM0	Salesforce.com	Mini Long	USD	81.00	USD	85.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMN	DE000CG9TMN8	Salesforce.com	Mini Long	USD	86.00	USD	90.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMP	DE000CG9TMP3	Salesforce.com	Mini Short	USD	124.00	USD	120.00	-3.66%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMQ	DE000CG9TMQ1	SanDisk	Mini Long	USD	39.00	USD	40.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMR	DE000CG9TMR9	Scientific Games	Mini Long	USD	8.50	USD	9.50	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMS	DE000CG9TMS7	Sohu	Mini Long	USD	37.50	USD	40.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMT	DE000CG9TMT5	Starbucks	Mini Long	USD	23.00	USD	24.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMU	DE000CG9TMU3	Starbucks	Mini Short	USD	29.00	USD	28.00	-3.66%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMV	DE000CG9TMV1	SunPower	Mini Long	USD	10.00	USD	12.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMW	DE000CG9TMW9	SunPower	Mini Long	USD	11.00	USD	13.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMX	DE000CG9TMX7	Suntech Power	Mini Long	USD	8.00	USD	9.00	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000
CG9TMY	DE000CG9TMY5	Suntech Power	Mini Long	USD	8.50	USD	9.50	4.34%	0.1	19.07.2010	5.000.000

<u>CG9TMZ</u>	<u>DE000CG9TMZ2</u>	<u>Suntech Power</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>9.00</u>	<u>USD</u>	<u>10.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNA</u>	<u>DE000CG9TNA3</u>	<u>Symantec</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>13.00</u>	<u>USD</u>	<u>14.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNE</u>	<u>DE000CG9TNE5</u>	<u>Tessera</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>13.00</u>	<u>USD</u>	<u>14.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNC</u>	<u>DE000CG9TNC9</u>	<u>Tessera</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>14.00</u>	<u>USD</u>	<u>15.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TND</u>	<u>DE000CG9TND7</u>	<u>Tessera</u>	<u>Mini Short</u>	<u>USD</u>	<u>19.00</u>	<u>USD</u>	<u>18.00</u>	<u>-3.66%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNE</u>	<u>DE000CG9TNE5</u>	<u>Tessera</u>	<u>Mini Short</u>	<u>USD</u>	<u>20.00</u>	<u>USD</u>	<u>19.00</u>	<u>-3.66%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNF</u>	<u>DE000CG9TNF2</u>	<u>Texas Instruments</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>22.50</u>	<u>USD</u>	<u>24.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNG</u>	<u>DE000CG9TNG0</u>	<u>Trina Solar</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>17.50</u>	<u>USD</u>	<u>18.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNH</u>	<u>DE000CG9TNH8</u>	<u>Trina Solar</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>18.50</u>	<u>USD</u>	<u>19.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNJ</u>	<u>DE000CG9TNJ4</u>	<u>Trina Solar</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>19.50</u>	<u>USD</u>	<u>20.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNK</u>	<u>DE000CG9TNK2</u>	<u>Vale</u>	<u>Mini Long</u>	<u>USD</u>	<u>17.50</u>	<u>USD</u>	<u>19.00</u>	<u>4.34%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>
<u>CG9TNL</u>	<u>DE000CG9TNL0</u>	<u>Vale</u>	<u>Mini Short</u>	<u>USD</u>	<u>29.50</u>	<u>USD</u>	<u>28.00</u>	<u>-3.66%</u>	<u>0.1</u>	<u>19.07.2010</u>	<u>5.000.000</u>

Tabelle 2:

Basiswert	Aktienart	ISIN oder Reuters-Code des Basiswertes	Maßgebliche Börse	Maßgebliche Anpassungsbörse für Basiswert („Anpassungsbörse“)	Berechnungstag	Währungsumrechnungstag	Referenzkurs des Basiswertes („Referenzkurs“)	Währung, in der der Referenzkurs ausgedrückt wird („Referenzwährung“)
<u>Adobe</u>	Stammaktien	<u>US00724F1012</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Advanced Micro Devices</u>	Stammaktien	<u>US0079031078</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Akamai</u>	Stammaktien	<u>US00971T1016</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Altria Group</u>	Stammaktien	<u>US02209S1033</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Amazon.com</u>	Stammaktien	<u>US0231351067</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>AIG</u>	Stammaktien	<u>US0268747849</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Apple Computer</u>	Stammaktien	<u>US0378331005</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>AT&T</u>	Stammaktien	<u>US00206R1023</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>BAIDU.COM</u>	ADRs	<u>US0567521085</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Bank of America</u>	Stammaktien	<u>US0605051046</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Caterpillar</u>	Stammaktien	<u>US1491231015</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Chesapeake</u>	Stammaktien	<u>US1651671075</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Cisco Systems</u>	Stammaktien	<u>US17275R1023</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Cognizant</u>	Stammaktien	<u>US1924461023</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>ConocoPhillips</u>	Stammaktien	<u>US20825C1045</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Deutsche Bank</u>	Stammaktien	<u>DE0005140008</u>	<u>Deutsche Börse</u>	<u>EUREX Frankfurt</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>Entfällt</u>	<u>Schlußauktionskurs im XETRA-Handelssystem</u>	<u>Euro (EUR)</u>
<u>eBay</u>	Stammaktien	<u>US2786421030</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Electronic Arts</u>	Stammaktien	<u>US2855121099</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>EMC</u>	Stammaktien	<u>US2686481027</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>General Electric</u>	Stammaktien	<u>US3696041033</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Goldman Sachs</u>	Stammaktien	<u>US38141G1040</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Google</u>	Stammaktien	<u>US38259P5089</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Hartford Financial Services</u>	Stammaktien	<u>US4165151048</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Hewlett-Packard</u>	Stammaktien	<u>US4282361033</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Intel</u>	Stammaktien	<u>US4581401001</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>IBM</u>	Stammaktien	<u>US4592001014</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Juniper Networks</u>	Stammaktien	<u>US48203R1041</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>

<u>Lanxess</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>DE0005470405</u>	<u>Deutsche Börse</u>	<u>EUREX Frankfurt</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>Entfällt</u>	<u>Schlußauktionskurs im XETRA- Handelssystem</u>	<u>Euro (EUR)</u>
<u>Marvell Technology</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>BMG5876H1051</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Micron Technology</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US5951121038</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Monsanto</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US61166W1018</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Motorola</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US6200761095</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>NetApp</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US64110D1046</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Oracle</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US68389X1054</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Pfizer</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US7170811035</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Qualcomm</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US7475251036</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Rambus</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US7509171069</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Research in Motion</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>CA7609751028</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>RWE</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>DE0007037129</u>	<u>Deutsche Börse</u>	<u>EUREX Frankfurt</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>Entfällt</u>	<u>Schlußauktionskurs im XETRA- Handelssystem</u>	<u>Euro (EUR)</u>
<u>Salesforce.com</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US79466L3024</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>SanDisk</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US80004C1018</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Scientific Games</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US80874P1093</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Sohu</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US83408W1036</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Starbucks</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US8552441094</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>SunPower</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US8676521094</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Suntech Power</u>	<u>ADRs</u>	<u>US86800C1045</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Symantec</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US8715031089</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Tessera</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US88164L1008</u>	<u>NASDAQ</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Texas Instruments</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US8825081040</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Trina Solar</u>	<u>Stammaktien</u>	<u>US89628E1047</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>
<u>Vale</u>	<u>ADRs</u>	<u>US91912E1055</u>	<u>NYSE</u>	<u>OCC</u>	<u>modifizierter Einlösungstag</u>	<u>modifizierter Berechnungstag + 1</u>	<u>Schlußkurs</u>	<u>US-Dollar (USD)</u>

Dabei bedeuten im Einzelnen:

Deutsche Börse, Frankfurt	: Deutsche Börse AG, Frankfurt, Deutschland
EUREX Deutschland	: EUREX Deutschland, Frankfurt, Deutschland
STOXX Limited, Zürich	: STOXX Limited, Zürich, Schweiz
Dow Jones & Company, Inc.	: Dow Jones & Company, Inc., New York, U.S.A.
NASDAQ Stock Market, Inc.	: NASDAQ Stock Market, Inc., Washington, D.C., U.S.A.
Nikkei Inc.	: Nikkei Inc., Tokio, Japan
Standard & Poor's Corp.	: Standard & Poor's Corp., New York, N.Y., U.S.A.
AEX-Options and Futures Exchange	: AEX-Options and Futures Exchange, Amsterdam, Niederlande
Bolsa de Derivados Portugal	: Bolsa de Derivados Portugal, Lissabon, Portugal
EUREX Zürich	: EUREX Schweiz, Zürich, Schweiz
Euronext Amsterdam/ Euronext Lissabon/ Euronext Paris	: Euronext Amsterdam N.V., Amsterdam, Niederlande/ Euronext Lissabon S.A., Lissabon, Portugal/ Euronext Paris S.A., Paris, Frankreich
Helsinki Securities and Derivatives Exchange, Clearing House (HEX Ltd.)	: Helsinki Securities and Derivatives Exchange, Clearing House (HEX Ltd.), Helsinki, Finnland
Helsinki Derivatives Exchange (HEX Ltd.)	: Helsinki Derivatives Exchange (HEX Ltd.), Helsinki, Finnland
HSIL	: Hang Seng Indexes Company Limited ("HSIL"), Hong Kong, China
Madrider Börse	: Bolsa de Madrid, Madrid, Spanien
MEFF	: Mercado de Futuros Financieros Madrid, Madrid, Spanien
NYSE	: New York Stock Exchange, New York, NY, USA
OCC	: Options Clearing Corporation, Chicago, Illinois, USA
OSE	: Osaka Securities Exchange, Osaka, Japan
TSE	: Tokyo Stock Exchange, Tokyo, Japan
virt-x	: virt-x Exchange Ltd., London, United Kingdom
SOQ	: Special Opening Quotation („SOQ“), ein spezieller zur Börseneröffnung ermittelter Referenzpreis. Für US-Indizes wird dieser auf der Seite www.cboe.com > Quotes & Data > Index Settlement Values veröffentlicht. Sofern am Verfalltag/Bewertungstag kein SOQ ermittelt wird, ist der offizielle Schlusskurs des Basiswerts der Referenzpreis.
Durchschnittskurs	: Ein während des letzten Tags der Laufzeit in fünf Minuten Intervallen ermittelter Durchschnittskurs.
Schlusskurs des DAX-Performance Index	: Bei DAX®/X-DAX® als Basiswert ist als Referenzkurs der offizielle Schlusskurs des DAX-Performance Index relevant.

Der Rest dieser Seite bleibt absichtlich leer.

Nr. 1 Optionsrecht

Citigroup Global Markets Deutschland AG, Frankfurt am Main (der "**Emittent**") gewährt hiermit dem Inhaber von Mini Futures Optionsscheinen (die "**Optionsscheine**"), bezogen auf den Basiswert, wie im einzelnen jeweils in der **Tabelle 1** und der **Tabelle 2** auf Seite 7 (und ggf. den nachfolgenden Seiten) dieser Optionsscheinbedingungen angegeben, das Recht (das "**Optionsrecht**"), nach Maßgabe dieser Optionsscheinbedingungen die Zahlung des Auszahlungsbetrages (Nr. 2 (1)) bzw. des Stopp-Loss Auszahlungsbetrages (Nr. 2a (2) bzw. des Kündigungsbetrages (Nr. 9 bzw. 9a) durch den Emittenten zu verlangen.

Nr. 2 Auszahlungsbetrag; Definitionen

(1) Der "**Auszahlungsbetrag**" je Optionsschein ist, vorbehaltlich des Eintritts eines Knock-Out Ereignisses (Nr. 2a (1)) oder der vorzeitigen Rückzahlung oder der Kündigung der Optionsscheine durch den Emittenten (Nr. 9 bzw. 9a), der Innere Wert eines Optionsscheins, sofern dieser bereits in der Auszahlungswährung ausgedrückt ist, oder der mit dem Referenzkurs der Währungsumrechnung in die Auszahlungswährung umgerechnete Innere Wert eines Optionsscheins.

(2) Der "**Innere Wert**" eines Optionsscheins ist,

vorbehaltlich einer Anpassung des Basispreises, der Knock-Out Schwelle, des Bezugsverhältnisses oder der sonstigen Ausstattungsmerkmale der Optionsscheine, die in der Referenzwährung ausgedrückte und mit dem Bezugsverhältnis multiplizierte Differenz, um die der am Berechnungstag festgestellte Referenzkurs des Basiswerts den jeweiligen Basispreis überschreitet (Mini Long) bzw. unterschreitet (Mini Short).

(3) In diesen Optionsscheinbedingungen bedeuten:

„Bankarbeitstag“:

Jeder Tag, an dem die Banken an dem jeweiligen Ort für Geschäfte, einschließlich des Handels in Fremdwährungen und der Entgegennahme von Fremdwährungseinlagen geöffnet sind (mit Ausnahme des Samstags und des Sonntags).

„Tag des ersten Angebotes“:

19.07.2010

„Mindesteinlösungsvolumen“:

Jeweils 1 Optionsschein je ISIN oder ein ganzzahliges Vielfaches hiervon.

„Berechnungstag“:

Berechnungstag ist der in Tabelle 2 definierte Tag.

„Modifizierter Berechnungstag“:

Der erste Berechnungstag gemäß der Definition in Tabelle 2, an dem von der Wechselkursreferenzstelle der Referenzkurs der Währungsumrechnung festgestellt und veröffentlicht wird.

„Modifizierter Berechnungstag + 1“:

Der erste auf den Berechnungstag gemäß der Definition in Tabelle 2 folgende Tag, an dem von der Wechselkursreferenzstelle der Referenzkurs der Währungsumrechnung festgestellt und veröffentlicht wird.

„Währungsumrechnungstag“:

Währungsumrechnungstag ist der in Tabelle 2 definierte Tag.

„Einlösungstag“:

Jeweils der letzte Bankarbeitstag eines jeden Monats am jeweiligen Ort der Einlösungsstelle gemäß Nr. 8 (1), an dem die Einlösungsvoraussetzungen gemäß Nr. 8 (1) und (2) um 10:00 Uhr (Ortszeit am Ort der jeweiligen Einlösungsstelle) erstmals erfüllt sind.

„Modifizierter Einlösungstag“:

Der Einlösungstag, sofern dieser zugleich ein Bankarbeitstag am Zusatzort und ein Handelstag sowie ein Tag ist, an dem an der in Tabelle 2 angegebenen Maßgeblichen Anpassungsbörse ein Handel in auf den Basiswert bezogenen Termin- und Optionskontrakten stattfindet, anderenfalls der erste auf den Einlösungstag folgende Tag, an dem die vorgenannten Bedingungen zutreffen.

„Modifizierter Einlösungstag + 1“:

Der erste auf den Einlösungstag folgende Tag, der erstmals zugleich ein Bankarbeitstag am Zusatzort und ein Handelstag sowie ein Tag ist, an dem an der in Tabelle 2 angegebenen Maßgeblichen Anpassungsbörse ein Handel in auf den Basiswert bezogenen Termin- und Optionskontrakten stattfindet.

„Anpassungstag“:

Ist der erste Bankarbeitstag in Frankfurt am Main eines jeden Monats.

„Anpassungszeitraum“:

Ist der Zeitraum vom Tag des ersten Angebots bis zum ersten Anpassungstag (einschließlich) und jeder folgende Zeitraum von einem Anpassungstag (ausschließlich) bis zum jeweils nächstfolgenden Anpassungstag (einschließlich).

„Anpassungsprozentsatz“:

Der Anpassungsprozentsatz für den 1. Anpassungszeitraum entspricht dem jeweils in der Tabelle 1 für den 1. Anpassungszeitraum genannten Prozentsatz. Der für jeden folgenden Anpassungszeitraum anwendbare Anpassungsprozentsatz setzt sich für Mini Long (*Mini Short*) Optionsscheine wie folgt zusammen: Summe (*Differenz*) aus dem (i) auf der Reuters-Seite:

EURIBOR1M=

(oder einer diese ersetzende Seite) für EUR-Rates Ref. Bzw.

USDVIEW

(oder einer diese ersetzende Seite) für US-Rates Ref. Bzw.

JPYVIEW

(oder eines diese ersetzende Seite) für Yen-Rates Ref. Bzw..

CHFLIBOR

(oder einer diese ersetzenden Seite) für CHF-Rates Ref.

veröffentlichten Zinssatz (der "Referenzzinssatz") an dem letzten Tag des jeweils vorangegangenen Anpassungszeitraums und (ii) dem in dem betreffenden Anpassungszeitraum geltenden Zinsbereinigungsfaktor. Sollte der vorgenannte Referenzzinssatz nicht mehr in einer der genannten Arten angezeigt werden, ist der Emittent berechtigt, als Referenzzinssatz einen auf der Basis der dann geltenden Marktusancen und unter Berücksichtigung der dann herrschenden Marktgegebenheiten ermittelten Referenzzinssatz nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) festzulegen.

„Zinsbereinigungsfaktor“:

Ist ein vom Emittenten nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) unter Berücksichtigung der jeweils herrschenden Marktgegebenheiten für einen Anpassungszeitraum festgelegter Zinssatz. Er kann für Long bzw. Short Optionsscheine unterschiedlich sein.

„Anpassung auf Grund von Dividendenzahlungen“:

Im Falle von auf eine Aktie bzw. auf eine oder mehrere der in einem Index vertretenen Aktien ausgeschütteten Dividenden bzw. Dividenden gleichstehenden Barausschüttungen wird der jeweils geltende Basispreis und gegebenenfalls die jeweils geltende Knock-Out Schwelle nach billigem Ermessen der Emittentin (§ 315 BGB) angepasst. Die Anpassung erfolgt mit Wirkung zu dem Tag, an dem die Aktie des betreffenden Unternehmens, auf die Dividenden bzw. Dividenden gleichstehende Barbeträge ausgeschüttet werden sollen, an ihrer jeweiligen Heimatbörse „ex Dividende“ gehandelt werden.

„Beobachtungszeitraum“:

Beobachtungszeitraum ist der Zeitraum vom Tag des ersten Angebotes (einschließlich) bis zum Berechnungstag (einschließlich), sofern nicht in Tabelle 1 ein anderer Beginn des Beobachtungszeitraums definiert ist.

„Zusatzort“:

London

„Zahltag bei Einlösung“:

Spätestens der fünfte auf den Einlösungstag folgende gemeinsame Bankarbeitstag am Sitz des Emittenten sowie am Ort der Zentralen Wertpapiersammelbank.

„Zahltag bei Kündigung“:

Spätestens der fünfte auf den Einlösungstag folgende gemeinsame Bankarbeitstag am Sitz des Emittenten sowie am Ort der Zentralen Wertpapiersammelbank.

„Wechselkursreferenzstelle“:

Referenzkurssystem EURO-FX, dessen Referenzkurse auf der Reutersseite „EUROFX/1“ veröffentlicht werden.

„Referenzkurs der Währungsumrechnung“:

Die Umrechnung von der Referenzwährung in die Auszahlungswährung erfolgt zu dem am Währungsumrechnungstag von der Wechselkursreferenzstelle gegen 13.00 Uhr Ortszeit Frankfurt am Main berechneten und für diesen veröffentlichten, in Mengennotierung ausgedrückten Briefkurs. Sofern der Berechnungsmodus des Referenzkurses der Währungsumrechnung von der Wechselkursreferenzstelle wesentlich verändert oder die Referenzkurse ganz eingestellt werden, ist der Emittent nach billigem Ermessen berechtigt, einen geeigneten Ersatz zu benennen.

„Zentrale Wertpapiersammelbank“:

Clearstream Banking Aktiengesellschaft, Frankfurt am Main.

„Clearinggebiet der zentralen Wertpapiersammelbank“:

Bundesrepublik Deutschland

„Weitere Wertpapiersammelbanken“:

Euroclear System, Brüssel; Clearstream Banking S.A., Luxemburg

„Auszahlungswährung“:

Euro

„Website des Emittenten“:

<http://www.citifirst.com>

Nr. 2a Knock-Out

(1) Falls der Beobachtungskurs des Basiswertes (Nr. 3 (2)), ausgedrückt in der Referenzwährung, während des Beobachtungszeitraums (Nr. 2 (3)) innerhalb der Beobachtungsstunden (Nr. 3 (2)) zu irgendeinem Zeitpunkt (nachfolgend der "**Knock-Out Zeitpunkt**" genannt) der in der Tabelle 1 genannten Knock-Out Schwelle (Nr. 2b (2)) des Optionsscheins entspricht oder diese unterschreitet (Mini Long Optionsscheine) bzw. entspricht oder diese überschreitet (Mini Short Optionsscheine) (das "**Knock-Out Ereignis**"), endet die Laufzeit der Optionsscheine mit dem Knock-Out Zeitpunkt vorzeitig. Sofern der Stopp-Loss-Auszahlungsbetrag gemäß Nr. 2a (2) positiv ist, erhält der Optionsscheininhaber den Stopp-Loss-Auszahlungsbetrag. Der Emittent wird das Erreichen oder Unterschreiten (Mini Long) bzw. Erreichen oder Überschreiten (Mini Short) der Knock-Out Schwelle unverzüglich gemäß Nr. 11 bekannt machen.

(2) Falls die Laufzeit der Optionsscheine durch ein Knock-Out Ereignis vorzeitig endet, wird der Emittent den Optionsscheininhabern einen etwaigen Stopp-Loss-Auszahlungsbetrag zahlen.

Der "**Stopp-Loss-Auszahlungsbetrag**" ist entweder der Innere Wert bei Stopp-Loss, sofern dieser bereits in der Auszahlungswährung ausgedrückt ist, oder der mit dem Stopp Loss-Wechselkurs in die Auszahlungswährung umgerechnete Innere Wert bei Stopp-Loss.

Der "**Innere Wert bei Stopp-Loss**" ist die in der Referenzwährung ausgedrückte und mit dem Bezugsverhältnis multiplizierte Differenz, um die der Hedge-Kurs den Basispreis überschreitet (Mini Long) bzw. unterschreitet (Mini Short).

"**Hedge-Kurs**" ist ein vom Emittenten nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) innerhalb von 120 Minuten nach Eintritt des Knock-Out Zeitpunktes festgelegter Kurs, der unter Berücksichtigung des rechnerischen Erlöses aus der Auflösung von entsprechenden Absicherungsgeschäften als der marktgerechte Stand des Basiswerts bestimmt wird. Der Hedge-Kurs entspricht dabei mindestens dem innerhalb von 120 Minuten nach Eintritt des Knock-Out Zeitpunktes festgestellten niedrigsten (Mini Long) bzw. höchsten (Mini Short) Kurs des Basiswerts.

"**Stopp Loss-Wechselkurs**" ist der vom Emittenten nach billigem Ermessen innerhalb von maximal 120 Minuten nach dem Eintritt des Knock-Out Zeitpunktes an Stelle des Referenzkurses der Währungsumrechnung festgelegte Wechselkurs.

Sollte der Knock-Out Zeitpunkt weniger als 120 Minuten vor dem Ende der üblichen Handelszeit an der maßgeblichen Börse eintreten, verlängert sich der nach dem vorstehenden Absatz zur Verfügung stehende Zeitraum für die Bestimmung des Hedge-Kurses ab Beginn der nächstfolgenden Börsensitzung entsprechend.

Sollte es während des dem Emittenten zur Bestimmung des Hedge-Kurses zur Verfügung stehenden Zeitraumes zu Marktstörungen im Sinne von Nr. 5 kommen und der Emittent bei Eintritt der Marktstörungen noch nicht den Hedge-Kurs bestimmt haben, verlängert sich der für die Bestimmung des Hedge-Kurses zur Verfügung stehende Zeitraum um die Dauer der Marktstörungen. Der Emittent bleibt auch während des Vorliegens von Marktstörungen zur Bestimmung des Hedge-Kurses bzw. zur Festlegung des Stopp-Loss Wechselkurses berechtigt.

Sollten die Marktstörungen im Sinne von Nr. 5 bis zum Ende des fünften auf den nächsten Einlösungstag der Optionsscheine folgenden Bankarbeitstages in Frankfurt am Main, am Zusatzort und am Ort der Maßgeblichen Börse andauern und der Emittent den Hedge-Kurs noch nicht bestimmt haben, wird der Emittent den Hedge-Kurs nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) unter Berücksichtigung der an diesem Tag herrschenden Marktgegebenheiten bestimmen.

Die Zahlung eines etwaigen Stopp-Loss-Auszahlungsbetrages erfolgt entsprechend Nr. 8 (4), wobei Zahltag bei Stopp-Loss spätestens der fünfte auf die Feststellung des Hedge-Kurses folgende Bankarbeitstag in Frankfurt am Main ist.

Nr. 2b Anpassungsbetrag

(1) Der jeweilige "**Basispreis**" einer Serie entspricht am Tag des ersten Angebots dem in Tabelle 1 genannten Wert. Nachfolgend wird der Basispreis an jedem Kalendertag während eines Anpassungszeitraums um den für diesen betreffenden Kalendertag von dem Emittenten berechneten Anpassungsbetrag verändert. Der Anpassungsbetrag für Mini Long bzw. Mini Short Optionsscheine kann unterschiedlich sein. Der für jeden Kalendertag innerhalb des jeweiligen Anpassungszeitraums gültige "**Anpassungsbetrag**" einer Serie entspricht dem Ergebnis der Multiplikation des Basispreises, der an dem in diesen Anpassungszeitraum fallenden Anpassungstag gültig ist, mit dem in diesem Anpassungszeitraum anwendbaren Anpassungsprozentsatz, wobei das Ergebnis unter Anwendung der Zinskonvention actual/360 auf einen Kalendertag umgerechnet wird.

Der sich für jeden Kalendertag ergebende Basispreis wird kaufmännisch auf drei Nachkommastellen gerundet, wobei jedoch der Berechnung des jeweils nachfolgenden Basispreises der ungerundete Basispreis des Vortages zu Grunde gelegt wird. Für den ersten Anpassungszeitraum ist der Basispreis am Tag des ersten Angebots für die bevorstehenden Berechnungen maßgeblich.

(2) Die jeweilige "**Knock-out Schwelle**" einer Serie entspricht für den ersten Anpassungszeitraum dem in Tabelle 1 genannten Wert. Für jeden weiteren Anpassungszeitraum wird die Knock-Out Schwelle an dem in diesen Anpassungszeitraum fallenden Anpassungstag vom Emittenten unter Berücksichtigung der jeweils herrschenden Marktgegebenheiten (insbesondere unter Berücksichtigung der Volatilität) nach billigem Ermessen (§315 BGB) festgelegt. Zusätzlich ist der Emittent berechtigt an Tagen, an denen nach Feststellung des Emittenten der Basispreis nach Anpassung (Nr. 2b (1)) der Knock-Out Schwelle entsprechen oder diese unter- bzw. überschreiten würde, gleichzeitig mit der Anpassung des Basispreises die Knock-Out Schwelle unter Berücksichtigung der jeweils herrschenden Marktgegebenheiten (insbesondere unter Berücksichtigung der Volatilität) nach billigem Ermessen (§315 BGB) anzupassen.

(3) Im Falle von Dividendenzahlungen oder Dividendenzahlungen gleichstehender sonstiger Barausschüttungen auf den Basiswert (anwendbar bei Aktien als Basiswert) oder auf die im Basiswert berücksichtigten Aktien (anwendbar bei Kursindizes als Basiswert) wird der jeweils geltende Basispreis und gegebenenfalls die Knock-Out Schwelle gemäß Nr. 2 (3) (Anpassung auf Grund von Dividendenzahlungen) angepasst.

Regelungen für Aktien als Basiswert:

Nr. 3 Basiswert

(1) Der „**Basiswert**“ entspricht der in der Tabelle 2 als Basiswert angegebenen Aktie bzw. dem aktienvertretenden Wertpapier der in der Tabelle 2 angegebenen Gesellschaft (die "**Gesellschaft**").

(2) Der "**Referenzkurs**" des Basiswerts entspricht dem in der Tabelle 2 als Referenzkurs des Basiswertes angegebenen Kurs, wie er an Handelstagen an der in der Tabelle 2 angegebenen Maßgeblichen Börse (die "**Maßgebliche Börse**") berechnet und veröffentlicht wird. Der "**Beobachtungskurs**" des Basiswerts entspricht den an der Maßgeblichen Börse an Handelstagen für den Basiswert fortlaufend berechneten und veröffentlichten Kursen (unter Ausschluss von Kursen, die auf Grundlage der untertägigen Mittagsauktion oder einer anderen untertägigen Auktion berechnet werden). "**Beobachtungsstunden**" sind die Handelsstunden. "**Handelstage**" sind Tage, an denen der Basiswert an der Maßgeblichen Börse üblicherweise gehandelt wird. "**Handelsstunden**" sind Stunden, während denen an der Maßgeblichen Börse an Handelstagen üblicherweise Kurse für den Basiswert festgestellt und veröffentlicht werden.

Nr. 4 Anpassungen

(1) Falls ein Anpassungsereignis gemäß Absatz 2 eintritt, bestimmt die Anpassungsstelle, ob das betreffende Anpassungsereignis einen Verwässerungs-, Konzentrations- oder sonstigen Effekt auf den rechnerischen Wert des Basiswerts hat und nimmt, falls dies der Fall sein sollte, gegebenenfalls eine entsprechende Anpassung der betroffenen Ausstattungsmerkmale der Optionsscheine vor, die nach ihrem billigem Ermessen sachgerecht ist, um dem Verwässerungs-, Konzentrations- oder sonstigen Effekt Rechnung zu tragen und die Optionsscheininhaber wirtschaftlich so weit wie möglich so zu stellen, wie sie vor dem Inkrafttreten des Anpassungsereignisses standen. Die Anpassungen können sich unter anderem auf den Basiskurs und das Bezugsverhältnis, andere maßgebliche Schwellen sowie darauf beziehen, dass der Basiswert durch einen Aktienkorb oder andere Vermögenswerte oder im Falle der Verschmelzung durch Aktien der aufnehmenden oder neu gebildeten Gesellschaft in angepasster Zahl ersetzt und gegebenenfalls eine andere Börse als Maßgebliche Börse und/oder eine andere Währung als Referenzwährung bestimmt wird. Die Anpassungsstelle kann (muss jedoch nicht) die Bestimmung dieser sachgerechten Anpassung an der Anpassung ausrichten, die eine Terminbörse, an der zum Zeitpunkt des Anpassungsereignisses Options- oder Terminkontrakte auf den Basiswert gehandelt werden, aus Anlass des betreffenden Anpassungsereignisses bei an dieser Terminbörse gehandelten Options- oder Terminkontrakten auf die jeweilige Aktie vornimmt.

(2) "**Anpassungsereignis**" ist:

(a) die Teilung (Aktiensplit), Zusammenlegung (Aktienkonsolidierung) oder Gattungsänderung der jeweiligen Aktien oder die Ausschüttung von Dividenden in Form von Bonus- oder Gratisaktien oder einer vergleichbaren Emission;

(b) die Erhöhung des Kapitals der Gesellschaft durch die Ausgabe neuer Aktien gegen Einlagen unter Einräumung eines unmittelbaren oder mittelbaren Bezugsrechts an ihre Aktionäre (Kapitalerhöhung gegen Einlagen);

(c) die Erhöhung des Kapitals der Gesellschaft aus Gesellschaftsmitteln (Kapitalerhöhung aus Gesellschaftsmitteln);

(d) die Einräumung des Bezugs von Schuldverschreibungen oder sonstigen Wertpapieren mit Options- oder Wandelrechten durch die Gesellschaft an ihre Aktionäre (Emission von Wertpapieren mit Options- oder Wandelrechten);

(e) die Ausschüttung einer Sonderdividende;

(f) die Abspaltung eines Unternehmensteils der Gesellschaft in der Weise, dass ein neues selbständiges Unternehmen entsteht oder der Unternehmensteil von einem dritten Unternehmen aufgenommen wird, wobei den Aktionären der Gesellschaft unentgeltlich Anteile entweder an dem neuen Unternehmen oder an dem aufnehmenden Unternehmen gewährt werden;

(g) die endgültige Einstellung der Notierung des Basiswertes an der Maßgeblichen Börse aufgrund einer Verschmelzung durch Aufnahme oder Neubildung oder aus einem sonstigen Grund;

(h) andere vergleichbare Ereignisse, die einen Verwässerungs-, Konzentrations- oder sonstigen Effekt auf den rechnerischen Wert des Basiswerts haben können.

(3) Auf aktienvertretende Wertpapiere als Basiswert (wie z.B. ADR, ADS, GDR) sind die in den vorstehenden Absätzen beschriebenen Regeln entsprechend anzuwenden.

(4) Veränderungen in der Art und Weise der Berechnung des Referenzkurses bzw. anderer gemäß diesen Optionsscheinbedingungen maßgeblicher Kurse oder Preise für den Basiswert, einschließlich der Veränderung der für den Basiswert maßgeblichen Handelstage und Handelsstunden berechtigen die Anpassungsstelle, das Optionsrecht nach billigem Ermessen entsprechend anzupassen.

Die Anpassungsstelle bestimmt unter Berücksichtigung des Zeitpunktes der Veränderung den Tag, zu dem das angepasste Optionsrecht erstmals zugrunde zu legen ist.

(5) Im Falle der endgültigen Einstellung der Notierung des Basiswertes an der Maßgeblichen Börse, in welchem Fall eine Notierung jedoch an einer anderen Börse oder einem anderen Markt besteht, die oder den der Emittent nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) für geeignet hält (die "Neue Maßgebliche Börse"), wird, sofern der Emittent die Optionsscheine nicht vorzeitig gemäß Nr. 9 kündigt, der Auszahlungsbetrag auf der Grundlage der an der Neuen Maßgeblichen Börse berechneten und veröffentlichten entsprechenden Kurse für den Basiswert berechnet. Ferner gilt dann jede in diesen Optionsscheinbedingungen enthaltene Bezugnahme auf die Maßgebliche Börse, sofern es der Zusammenhang erlaubt, als Bezugnahme auf die Neue Maßgebliche Börse.

(6) Im Falle der Einleitung einer freiwilligen oder zwangsweisen Liquidation, Konkurses, Insolvenz, Abwicklung, Auflösung oder eines vergleichbaren die Gesellschaft betreffenden Verfahrens oder im Falle eines Vorganges, durch den alle Aktien der Gesellschaft oder alle oder im Wesentlichen alle Vermögenswerte der Gesellschaft verstaatlicht oder enteignet werden oder sonst auf staatliche Stellen, Behörden oder Einrichtungen übertragen werden müssen oder sollte der Emittent nach Eintritt eines sonstigen Ereignisses zu dem Ergebnis gelangen, dass durch eine Anpassung keine wirtschaftlich sachgerechte Anpassung an die eingetretenen Änderungen möglich ist, wird der Emittent die Optionsscheine gemäß Nr. 9 kündigen.

(7) Die Berechnung der Anpassungen wird durch die Anpassungsstelle vorgenommen. Die „**Anpassungsstelle**“ ist ein Sachverständiger, der von dem Emittenten nach billigem Ermessen unverzüglich nach Eintreten eines Ereignisses, das eine Anpassung erfordert, benannt und unverzüglich mit der Berechnung der Anpassungen für die Optionsscheine beauftragt wird. Die in den vorgenannten Absätzen erwähnten Entscheidungen der Anpassungsstelle sind abschließend und verbindlich, es sei denn, es liegt ein offensichtlicher Irrtum vor. Der Emittent wird die von der Anpassungsstelle festgelegten Anpassungen und den Zeitpunkt des Wirksamwerdens der Anpassungen gemäß Nr. 11 bekanntmachen.

Nr. 5 Marktstörungen

(1) Wenn nach Auffassung des Emittenten an dem Berechnungstag eine Marktstörung gemäß Absatz (2) vorliegt, dann wird der Berechnungstag auf den nächstfolgenden Tag, der die Kriterien für einen Berechnungstag gemäß Nr. 2 (3) erfüllt, und an dem keine Marktstörung mehr vorliegt verschoben. Der Emittent wird sich bemühen, den Optionsscheininhabern unverzüglich gemäß Nr. 11 bekanntzumachen, dass eine Marktstörung eingetreten ist. Eine Pflicht zur Bekanntmachung besteht jedoch nicht. Wenn der Berechnungstag aufgrund der Bestimmungen dieses Absatzes um 5 hintereinander liegende Tage, die die Kriterien für einen Berechnungstag gemäß Nr. 2 (3) erfüllen, verschoben worden ist und auch an diesem Tag die Marktstörung fortbesteht, dann gilt dieser Tag als der Berechnungstag, wobei der Emittent den Auszahlungsbetrag nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) unter Berücksichtigung der an einem solchen angenommenen Berechnungstag herrschenden Marktgegebenheiten bestimmen wird.

(2) "**Marktstörung**" bedeutet

(i) die Suspendierung oder Einschränkung des Handels in dem Basiswert an der Maßgeblichen Börse, oder

(ii) die Suspendierung oder Einschränkung des Handels (einschließlich des Leihemarktes) in einem Termin- oder Optionskontrakt in Bezug auf den Basiswert an einer Terminbörse, an der Termin- oder Optionskontrakte bezogen auf den Basiswert gehandelt werden (die "**Terminbörse**");

soweit eine solche Suspendierung oder Einschränkung in der letzten halben Stunde vor der üblicherweise zu erfolgenden Berechnung des Schlusskurses des Basiswertes eintritt bzw. besteht und nach Auffassung des Emittenten wesentlich ist. Eine Änderung der Handelstage oder Handelsstunden, an denen der Basiswert gehandelt wird, begründet keine Marktstörung, vorausgesetzt, dass die Änderung aufgrund einer zuvor angekündigten Änderung der Handelsregularien durch die Maßgebliche Börse erfolgt.

Nr. 6 Form der Optionsscheine, Girosammelverwahrung, Status, Aufstockung, Rückkauf

(1) Jede Serie der vom Emittenten begebenen Optionsscheine ist jeweils in einem Inhaber-Sammeloptionsschein (nachfolgend "Inhaber-Sammeloptionsschein" genannt) verbrieft, der bei der Zentralen Wertpapiersammelbank gemäß Nr. 2 (3) hinterlegt ist. Effektive Optionsscheine werden während der gesamten Laufzeit nicht ausgegeben. Das Recht auf Lieferung effektiver Stücke ist ausgeschlossen.

(2) Die Übertragung der Optionsscheine erfolgt als Miteigentumsanteile am jeweiligen Inhaber-Sammeloptionsschein gemäß den Regeln der Zentralen Wertpapiersammelbank und, außerhalb des Clearinggebietes der Zentralen Wertpapiersammelbank, der weiteren Wertpapiersammelbanken gemäß Nr. 2 (3) oder im Falle von Nr. 13 (6) anderer ausländischer Wertpapiersammelbanken oder Lagerstellen.

(3) Die Optionsscheine begründen unmittelbare, unbesicherte und nicht nachrangige Verbindlichkeiten des Emittenten, die untereinander und mit allen sonstigen gegenwärtigen und künftigen unbesicherten und nicht nachrangigen Verbindlichkeiten des Emittenten gleichrangig sind, ausgenommen solche Verbindlichkeiten, denen auf Grund zwingender gesetzlicher Vorschriften Vorrang zukommt.

(4) Der Emittent ist berechtigt, ohne Zustimmung der Optionsscheininhaber jederzeit weitere Optionsscheine mit gleicher Ausstattung zu begeben, so dass sie mit den Optionsscheinen zusammen gefasst werden, eine einheitliche Emission mit ihnen bilden und ihre Anzahl erhöhen. Der Begriff "Optionsscheine" umfasst im Falle einer solchen Aufstockung auch solche zusätzlich begebenen Optionsscheine.

(5) Der Emittent ist berechtigt, jederzeit Optionsscheine über die Börse oder durch außerbörsliche Geschäfte zu einem beliebigen Preis zurückzuerwerben. Der Emittent ist nicht verpflichtet, die Optionsscheininhaber davon zu unterrichten. Die zurückerworbenen Optionsscheine können entwertet, gehalten, weiterveräußert oder von dem Emittenten in anderer Weise verwendet werden.

Nr. 7

Verkaufsbeschränkungen

(1) Eine Registrierung der Optionsscheine unter dem "United States Securities Act" von 1933 in der jeweiligen Fassung erfolgt nicht; der Handel in den Optionsscheinen ist nicht von der "United States Commodity Futures Trading Commission" ("CFTC") unter dem "United States Commodity Exchange Act" zugelassen. Die Optionsscheine dürfen zu keinem Zeitpunkt direkt oder indirekt in den Vereinigten Staaten von Amerika, ihren Territorien oder Besitzungen oder an oder durch U.S. Personen angeboten, verkauft oder ausgeliefert werden. Bei Einlösung der Optionsrechte sind die Optionsscheininhaber verpflichtet zu versichern, dass die Optionsscheine weder direkt noch indirekt für eine U.S. Person gehalten werden. Der Emittent ist nicht bei der CFTC als Makler ("commission merchant") registriert. Mit Kauf und Annahme der Optionsscheine versichert der Optionsscheininhaber, dass er keine United States-Person wie nachstehend definiert ist und dass er, sollte er in Zukunft unter die Definition einer United States Person fallen, die Optionsscheine noch vorher verkaufen wird; der Optionsscheininhaber sichert weiterhin zu, dass er die Optionsscheine zu keinem Zeitpunkt in den Vereinigten Staaten direkt oder indirekt angeboten, verkauft oder gehandelt hat und dies auch in Zukunft nicht tun wird; der Optionsscheininhaber sichert außerdem zu, (a) dass er die Optionsscheine zu keinem Zeitpunkt einer United States Person direkt oder indirekt angeboten, verkauft oder mit einer solchen gehandelt hat und dass er dies auch in Zukunft (weder für sich noch für Dritte) tun wird und (b) dass er die Optionsscheine nicht für Rechnung einer United States Person gekauft hat. Der Optionsscheininhaber verpflichtet sich, bei einem Verkauf der Optionsscheine dem Käufer diese Verkaufsbeschränkungen - einschließlich nachfolgender Erläuterungen - auszuhändigen oder den Käufer auf diese Verkaufsbeschränkungen schriftlich hinzuweisen.

Es gelten folgende Definitionen: "Vereinigte Staaten" bedeuten die Vereinigten Staaten von Amerika (einschließlich deren Staaten, des "District of Columbia", sowie der Territorien, Besitzungen und sonstigen Gebiete unter deren Jurisdiktion); "United States Person" bedeutet Bürger oder Gebietsansässiger der Vereinigten Staaten von Amerika sowie Kapital- und Personengesellschaften oder sonstige nach dem Recht der Vereinigten Staaten von Amerika oder einer ihrer Gebietskörperschaften begründete oder organisierte Gesellschaften sowie Erbschafts- oder Treuhandvermögen, die unabhängig von der Quelle ihrer Einkünfte der Besteuerung der Vereinigten Staaten von Amerika unterliegen.

(2) Bei jeder Tätigkeit im Zusammenhang mit Citigroup Optionsscheinen/Zertifikaten oder anderen derivaten Produkten im Vereinigten Königreich müssen alle anwendbaren Bestimmungen des "Financial Services and Markets Act 2000 (nachfolgend "FSMA")" beachtet werden. Jede Verbreitung von Angeboten oder von Anreizen zur Aufnahme einer Investment Aktivität i.S.v. Paragraph 21 der FSMA darf im Zusammenhang mit der Emission oder dem Verkauf von Optionsscheinen/Zertifikaten oder anderen derivativen Produkten nur in solchen Fällen vorgenommen oder veranlasst werden, in denen Paragraph 21 der FSMA nicht anwendbar ist. In Bezug auf Wertpapiere mit einer Laufzeit von weniger als einem Jahr ist zudem Folgendes zu beachten: (i) die Wertpapiere dürfen nur von Personen verkauft werden, deren gewöhnliche Geschäftstätigkeit darin besteht, im Rahmen ihres Geschäftszwecks Anlagen zu erwerben, zu halten, zu verwalten oder zu veräußern (als Auftraggeber oder Beauftragter), und (ii) diese Personen haben keine Wertpapiere angeboten oder verkauft und werden keine Wertpapiere anbieten oder verkaufen, außer an Personen, deren gewöhnliche Geschäftstätigkeit darin besteht, im Rahmen ihres Geschäftszwecks Anlagen zu erwerben, zu halten, zu verwalten oder zu veräußern (als Auftraggeber oder Beauftragter), da die Begebung der Wertpapiere andernfalls einen Verstoß der Emittentin gegen Paragraph 19 des FSMA darstellen würde.

(3) In Bezug auf jeden Mitgliedstaat des Europäischen Wirtschaftsraums, der die Prospektrichtlinie umgesetzt hat (jeweils ein "Betreffender Mitgliedstaat"), wurde bzw. wird für die Optionsscheine ab einschließlich dem Tag der Umsetzung der Prospektrichtlinie in diesem Betreffenden Mitgliedstaat (der "Betreffende Umsetzungstag") kein öffentliches Angebot unterbreitet. Unter folgenden Bedingungen können die Optionsscheine jedoch ab einschließlich dem Betreffenden Umsetzungstag in dem Betreffenden Mitgliedstaat öffentlich angeboten werden:

(a) in dem Zeitraum ab dem Tag der Veröffentlichung des Basisprospekts in Bezug auf diese Optionsscheine, der von den zuständigen Behörden dieses Betreffenden Mitgliedstaats gebilligt wurde bzw. in einem anderen Betreffenden Mitgliedstaat gebilligt und die zuständige Behörde in diesem Betreffenden Mitgliedstaat unterrichtet wurde, jeweils in Übereinstimmung mit der Prospektrichtlinie, bis zu dem Tag, der 12 Monate nach dem Tag der Veröffentlichung liegt;

(b) an juristische Personen, die in Bezug auf ihre Tätigkeit auf den Finanzmärkten zugelassen sind bzw. beaufsichtigt werden, oder, falls sie nicht zugelassen sind oder beaufsichtigt werden, deren einziger Geschäftszweck in der Wertpapieranlage besteht;

(c) an juristische Personen, die laut ihrem letzten Jahresabschluss bzw. konsolidierten Jahresabschluss mindestens zwei der nachfolgenden Kriterien erfüllen: (1) eine durchschnittliche Beschäftigtenzahl im letzten Geschäftsjahr von mindestens 250, (2) eine Gesamtbilanzsumme von über EUR 43.000.000 und (3) ein Jahresnettoumsatz von über EUR 50.000.000;

(d) sofern sich das Angebot an weniger als 100 natürliche oder juristische Personen in diesem Betreffenden Mitgliedstaat richtet, bei denen es sich nicht um qualifizierte Anleger im Sinne des Artikels 2 der Prospektrichtlinie handelt; oder

(e) unter anderen Umständen, die eine Veröffentlichung eines Prospekts durch den Emittenten gemäß Artikel 3 der Prospektrichtlinie nicht erfordern,

Für die Zwecke dieser Vorschrift bezeichnet der Ausdruck "öffentliches Angebot von Wertpapieren" (wie ggf. durch Maßnahmen im Betreffenden Mitgliedstaat zur Umsetzung der Prospektrichtlinie in diesem Betreffenden Mitgliedstaat geändert) in Bezug auf Wertpapiere in einem Betreffenden Mitgliedstaat eine Mitteilung in jedweder Form und auf jedwede Art und Weise, die ausreichende Informationen über die Angebotsbedingungen und die anzubietenden Wertpapiere enthält, um einen Anleger in die Lage zu versetzen, sich für den Kauf oder die Zeichnung dieser Wertpapiere zu entscheiden; "Prospektrichtlinie" bezeichnet die Richtlinie 2003/71/EG und umfasst die jeweiligen Umsetzungsmaßnahmen in dem Betreffenden Mitgliedstaat.

(4) Bei jeder Tätigkeit im Zusammenhang mit den Optionsscheinen, insbesondere deren Erwerb oder Verkauf bzw. der Einlösung der Optionsrechte aus den Optionsscheinen sind durch die Optionsscheininhaber sowie jeden anderen beteiligten Marktteilnehmer die in dem jeweiligen Land geltenden gesetzlichen Bestimmungen zu beachten. Üblicherweise darf ein öffentliches Angebot der Optionsscheine nur erfolgen, wenn zuvor ein den gesetzlichen Bestimmungen des Landes, in dem das öffentliche Angebot erfolgt, entsprechender Verkaufsprospekt bzw. Börsenprospekt von der zuständigen Behörde genehmigt und veröffentlicht wurde. Die Veröffentlichung muss üblicherweise durch die Person erfolgen, die ein entsprechendes Angebot in der betreffenden Jurisdiktion unterbreitet. Optionsscheininhaber bzw. an einem Erwerb interessierte Personen sind daher gehalten, sich über die diesbezüglichen gesetzlichen Bestimmungen jederzeit zu informieren und sie zu beachten.

Nr. 8 Einlösung der Optionsrechte

(1) Die Optionsscheine können vom Optionsscheininhaber nur mit Wirkung zu einem Einlösungstag gemäß Nr. 2 (3) eingelöst werden. Zur wirksamen Einlösung der Optionsscheine muss der Optionsscheininhaber des jeweiligen Optionsscheines bis spätestens 10:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) am Einlösungstag die nachstehend genannten Voraussetzungen gegenüber der jeweiligen Einlösungsstelle erfüllen. Zusätzlich gelten die Bestimmungen in Ziffern 2 bis 4.

Bei Einlösung der Optionsrechte gegenüber der Einlösungsstelle in der Bundesrepublik Deutschland muss der Optionsscheininhaber der Citigroup Global Markets Deutschland AG an folgende Adresse:

Citigroup Global Markets
Deutschland AG
Attn. Securities
Frankfurter Welle
Reuterweg 16
D-60323 Frankfurt am Main
Bundesrepublik Deutschland

Unter Verwendung des beim Emittenten erhältlichen Vordrucks eine ordnungsgemäß ausgefüllte Einlösungserklärung „Frankfurt“ für die jeweilige WKN (nachfolgend „Einlösungserklärung“ genannt) vorlegen, und die Optionsscheine, die eingelöst werden sollen, übertragen haben

- an den Emittenten auf sein Konto-Nr. 7098 bei Clearstream Frankfurt oder sein Konto-Nr. 67098 bei Clearstream Luxemburg oder

- an Euroclear; und dem Emittenten eine Bestätigung von Euroclear zugegangen sein, wonach die Optionsscheine zugunsten des Optionsscheininhabers auf einem Konto bei Euroclear gebucht waren und Euroclear die unwiderrufliche Übertragung der Optionsscheine auf eines der beiden zuvor genannten Konten des Emittenten veranlasst hat.

In der Einlösungserklärung müssen angegeben werden:

- die WKN der Optionsscheinserie und die Zahl der Optionsscheine, die eingelöst werden sollen und

- das Konto des Optionsscheininhabers bei einem Kreditinstitut in der Bundesrepublik Deutschland, auf das der Auszahlungsbetrag zu zahlen ist. Ist in der Einlösungserklärung kein Konto oder ein Konto außerhalb der Bundesrepublik Deutschland angegeben, wird dem Optionsscheininhaber innerhalb von 5 Bankarbeitstagen in Frankfurt am Main nach dem Berechnungstag auf sein Risiko mit einfacher Post ein Scheck über den Auszahlungsbetrag an die in der Einlösungserklärung angegebene Adresse übersandt.

- Ferner ist zu bestätigen, dass der Berechtigte aus den Optionsscheinen keine United States Person gemäß Nr. 7 (1) ist und er die Optionsscheine in Übereinstimmung mit Nr. 7 erworben hat.

(2) Die Einlösungserklärung wird am Einlösungstag gemäß Nr. 2 (3) wirksam.

Ein Widerruf der Einlösungserklärung ist auch vor Wirksamwerden der Erklärung ausgeschlossen.

Sämtliche in Nr. 8 (1) genannten Voraussetzungen sind innerhalb von 15 Bankarbeitstagen nach dem Eintreten der ersten Voraussetzung zu erfüllen. Andernfalls ist der Emittent berechtigt, dem Optionsscheininhaber bereits vorgenommene Leistungen auf seine Gefahr und Kosten zinslos zurückzugewähren; die Einlösungserklärung wird in diesem Fall nicht wirksam.

(3) Alle im Zusammenhang mit der Einlösung der Optionsscheine etwa anfallenden Steuern oder sonstigen Abgaben sind vom Optionsscheininhaber zu tragen.

Der Einlösungs- bzw. Abrechnungsbetrag wird in der Auszahlungswährung gezahlt, ohne dass der Emittent oder die Einlösungsstelle zur Abgabe irgendwelcher Erklärungen verpflichtet sind.

(4) Der Emittent wird einen eventuellen Einlösungsbetrag am Zahltag bei Einlösung an die Zentrale Wertpapiersammelbank zur Gutschrift an die bei der Zentralen Wertpapiersammelbank am vorangegangenen Bankarbeitstag am Sitz der Zentralen Wertpapiersammelbank bei Geschäftsschluss registrierten Optionsscheininhaber überweisen.

Die Zentrale Wertpapiersammelbank hat sich gegenüber dem Emittenten zu einer entsprechenden Weiterleitung verpflichtet.

Nr. 9 Vorzeitige Rückzahlung

(1) Der Emittent ist berechtigt sämtliche Optionsscheine einer Serie bei Eintritt eines der nachfolgend beschriebenen Ereignisse durch Bekanntmachung gemäß Nr. 11 unter Angabe des gemäß Absatz 3 definierten Kündigungsbetrages zu kündigen und vorzeitig fällig zu stellen. "Kündigungsereignisse" sind

(a) der Eintritt eines vom Emittenten nicht zu vertretenden Umstandes, der dazu führt, dass die Erfüllung seiner Verpflichtungen aus den Optionsscheinen ganz oder teilweise – gleich aus welchem Grund – rechtswidrig oder undurchführbar oder bei wirtschaftlicher Betrachtungsweise unzumutbar wird oder geworden ist, oder

(b) eine Änderung der Rechtslage bzw. behördliche Auflagen oder Weisungen, die dazu führen, dass die Aufrechterhaltung der Hedge-Positionen des Emittenten rechtswidrig geworden ist, oder

(c) der Eintritt eines vom Emittenten nicht zu vertretenden Umstandes, der es verhindert oder unzumutbar macht, dass der Emittent (i) mittels marktüblicher und legaler Transaktionen am Devisenmarkt die Referenzwährung des Basiswerts in die Auszahlungswährung der Optionsscheine konvertiert oder (ii) in der Referenzwährung des Basiswerts gehaltene Einlagen aus einer bestimmten Jurisdiktion in eine andere transferieren kann, oder (iii) der Eintritt sonstiger von dem Emittenten nicht zu vertretender Umstände, die auf die Konvertibilität der Referenzwährung des Basiswerts in die Auszahlungswährung der Optionsscheine einen vergleichbaren negativen Einfluss haben, sofern der Emittent aufgrund dieser Umstände zu dem Ergebnis gelangt, dass eine Umrechnung der Referenzwährung des Basiswerts in die Auszahlungswährung der Optionsscheine nicht mehr möglich ist, oder

(d) der Eintritt vom Emittenten nicht zu vertretender Umstände gemäß den Bestimmungen der Nr. 4 (Anpassungen), die dazu führen, dass keine wirtschaftlich sachgerechten Anpassungen an die eingetretenen Änderungen möglich sind.

(2) Jede Kündigungsbekanntmachung nach Maßgabe dieser Nr. 9 ist unwiderruflich und muss den Kündigungstermin benennen. Eine Kündigung durch den Emittenten gemäß Absatz 1 wird am Tage der Bekanntmachung gemäß Nr. 11 bzw., falls abweichend, an dem in der Bekanntmachungsanzeige genannten Tag wirksam.

(3) Im Fall einer Kündigung gemäß Absatz 1 zahlt der Emittent an jeden Optionsscheininhaber bezüglich jedes von ihm gehaltenen Optionsscheins einen Betrag (der "Kündigungsbetrag"), der von dem Emittenten nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) als angemessener Marktpreis eines Optionsscheins festgelegt wird. Der Emittent wird in diesem Fall für alle von der Kündigung betroffenen Optionsscheine den Kündigungsbetrag innerhalb von 5 Bankarbeitstagen am Sitz des Emittenten sowie am Ort der Zentralen Wertpapiersammelbank nach dem Tag des Wirksamwerdens der Kündigung an die Zentrale Wertpapiersammelbank zur Gutschrift an die bei der Zentralen Wertpapiersammelbank am zweiten Tag nach Wirksamwerden der Kündigung („Zahltage bei Vorzeitiger Rückzahlung“) registrierten Optionsscheininhaber überweisen.

Die Zentrale Wertpapiersammelbank hat sich gegenüber dem Emittenten zu einer entsprechenden Weiterleitung verpflichtet.

Sollte die Weiterleitung nicht innerhalb von drei Monaten nach dem Zahltag bei Vorzeitiger Rückzahlung möglich sein („Vorlegungsfrist“), ist der Emittent berechtigt, die entsprechenden Beträge beim Amtsgericht in Frankfurt am Main für die Optionsscheininhaber auf deren Gefahr und Kosten unter Verzicht auf das Recht zur Rücknahme zu hinterlegen. Mit der Hinterlegung erlöschen die Ansprüche der Optionsscheininhaber gegen den Emittenten.

Nr. 9a Kündigung

(1) Der Emittent ist berechtigt, sämtliche Optionsscheine einer Serie während ihrer Laufzeit mit einer Kündigungsfrist von 4 Wochen durch Bekanntmachung gemäß Nr. 11 mit Wirkung zu dem in der Bekanntmachung genannten Kündigungstermin (der "Kündigungstermin") zu kündigen. Eine Kündigung gemäß Nr. 9a kann erstmals 3 Monate nach dem Tag des ersten Angebotes erfolgen. Jede Kündigungsbekanntmachung nach Maßgabe dieser Nr. 9a ist unwiderruflich und muss den Kündigungstermin benennen. Die Kündigung wird an dem in der Bekanntmachungsanzeige genannten Tag wirksam. Für die Zwecke der Berechnung des Auszahlungsbetrages gemäß Nr. 2 gilt der Tag des Wirksamwerdens der Kündigung als Berechnungstag im Sinne dieser Optionsscheinbedingungen.

(2) Im Falle der Kündigung durch den Emittenten findet Nr. 8 keine Anwendung. Einlösungstag im Sinne der Nr. 2 (3) ist in diesem Fall der Tag, an dem die Kündigung wirksam wird. Zahltag ist der Zahltag bei Kündigung gemäß Nr. 9a (3).

(3) Der Emittent wird in diesem Fall für alle von der Kündigung betroffenen Optionsscheine den Einlösungsbetrag innerhalb von 5 Bankarbeitstagen am Sitz des Emittenten sowie am Ort der Zentralen Wertpapiersammelbank nach dem Einlösungstag an die Zentrale Wertpapiersammelbank zur Gutschrift an die bei der Zentralen Wertpapiersammelbank am zweiten Tag nach dem Einlösungstag (nachfolgend „Zahltag bei Kündigung“ genannt) registrierten Optionsscheininhaber überweisen.

Die Zentrale Wertpapiersammelbank hat sich gegenüber dem Emittenten zu einer entsprechenden Weiterleitung verpflichtet.

Sollte die Weiterleitung nicht innerhalb von drei Monaten nach dem Zahltag möglich sein („Vorlegungsfrist“), ist der Emittent berechtigt, die entsprechenden Beträge beim Amtsgericht in Frankfurt am Main für die Optionsscheininhaber auf deren Gefahr und Kosten unter Verzicht auf das Recht zur Rücknahme zu hinterlegen. Mit der Hinterlegung erlöschen die Ansprüche der Optionsscheininhaber gegen den Emittenten.

Nr. 10 Vorlegungsfrist, Verschiebung der Fälligkeit

(1) Die Vorlegungsfrist nach § 801 Abs. 1 Satz 1 BGB ist auf zehn Jahre reduziert.

(2) Sollte die Citigroup Global Markets Deutschland AG oder die jeweilige Zahlstelle tatsächlich oder rechtlich nicht in der Lage sein, ihre Verbindlichkeiten aus den Optionsscheinen in rechtlich zulässiger Weise in Frankfurt am Main bzw. am Ort der jeweiligen Zahlstelle zu erfüllen, verschiebt sich die Fälligkeit dieser Verbindlichkeiten bis zu dem Zeitpunkt, zu dem es der Citigroup Global Markets Deutschland AG bzw. der jeweiligen Zahlstelle tatsächlich und rechtlich wieder möglich ist, ihre Verbindlichkeiten in Frankfurt am Main bzw. am Ort der Zahlstelle zu erfüllen. Den Optionsscheininhabern stehen aufgrund einer solchen Verschiebung der Fälligkeit keine Rechte gegen das in Frankfurt am Main oder sonst wo belegene Vermögen der Citigroup Global Markets Deutschland AG bzw. der Zahlstelle zu.

(3) Der Emittent wird den Eintritt und den Wegfall eines in Nr. 10 (2) beschriebenen Ereignisses unverzüglich gemäß Nr. 11 bekannt machen.

Nr. 11 Bekanntmachungen

Sofern die zum jeweiligen Zeitpunkt in den Ländern, in denen die Optionsscheine öffentlich angeboten bzw. börsennotiert werden, einschlägigen gesetzlichen Bestimmungen nichts anderes vorschreiben, erfolgt die Veröffentlichung in einer oder mehreren Zeitungen, die in den Staaten, in denen das öffentliche Angebot unterbreitet oder die Zulassung zum Börsenhandel angestrebt bzw. betrieben wird, gängig sind oder in großer Auflage verlegt werden. Zur Rechtswirksamkeit ist die Veröffentlichung in einer dieser Zeitungen ausreichend. Der Emittent ist berechtigt, Bekanntmachungen statt in den genannten Zeitungen auf seiner Website zu veröffentlichen. Der Emittent wird eine solche Änderung des Veröffentlichungsmediums in einer der genannten Zeitungen bekannt machen.

Nr. 12 Ersetzung des Emittenten

(1) Der Emittent ist jederzeit berechtigt, ohne Zustimmung der Optionsscheininhaber eine andere Gesellschaft als Emittenten (der "Neue Emittent") hinsichtlich aller Verpflichtungen aus oder in Verbindung mit den Optionsscheinen an die Stelle des Emittenten zu setzen, sofern

(a) der Neue Emittent alle Verpflichtungen des Emittenten aus oder in Verbindung mit den Optionsscheinen übernimmt (die "Übernahme");

(b) die Übernahme keine nachteiligen bonitätsmäßigen, finanziellen, rechtlichen und steuerlichen Folgen für die Optionsscheininhaber hat und dies durch eine von dem Emittenten auf seine Kosten speziell für diesen Fall zu bestellende unabhängige Treuhänderin, die eine Bank oder Wirtschaftsprüfungsgesellschaft mit internationalem Ansehen ist (die "Treuhänderin"), bestätigt wird;

(c) der Emittent oder ein anderes von der Treuhänderin genehmigtes Unternehmen sämtliche Verpflichtungen des Neuen Emittenten aus den Optionsscheinen zugunsten der Optionsscheininhaber garantiert; und

(d) der Neue Emittent alle notwendigen Genehmigungen von den zuständigen Behörden erhalten hat, damit der Neue Emittent alle Verpflichtungen aus oder in Verbindung mit den Optionsscheinen erfüllen kann.

(2) Im Falle einer solchen Ersetzung des Emittenten gilt jede in diesen Optionsscheinbedingungen enthaltene Bezugnahme auf den Emittent als auf den Neuen Emittenten bezogen.

(3) Die Ersetzung des Emittenten wird gemäß Nr. 11 bekannt gemacht. Mit Erfüllung der vorgenannten Bedingungen tritt der Neue Emittent in jeder Hinsicht an die Stelle des Emittenten und der Emittent wird von allen mit der Funktion als Emittent zusammenhängenden Verpflichtungen gegenüber den Optionsscheininhabern aus oder im Zusammenhang mit den Optionsscheinen befreit.

Nr. 13 Verschiedenes

(1) Form und Inhalt der Optionsscheine sowie alle Rechte und Pflichten aus den in diesen Bedingungen geregelten Angelegenheiten bestimmen sich in jeder Hinsicht nach dem Recht der Bundesrepublik Deutschland.

(2) Ausschließlicher Gerichtsstand für alle Klagen oder sonstigen Verfahren aus oder im Zusammenhang mit den Optionsscheinen ist Frankfurt am Main.

(3) Erfüllungsort ist Frankfurt am Main.

(4) Der Emittent ist berechtigt, in diesen Bedingungen ohne Zustimmung der Optionsscheininhaber (i) offensichtliche Schreib- oder Rechenfehler zu berichtigen sowie (ii) widersprüchliche oder lückenhafte Bestimmungen zu ändern bzw. zu ergänzen, wobei in den unter (ii) genannten Fällen nur solche Änderungen bzw. Ergänzungen zulässig sind, die unter Berücksichtigung der Interessen des Emittenten für die Optionsscheininhaber zumutbar sind, d.h. die die finanzielle Situation der Optionsscheininhaber nicht wesentlich verschlechtern bzw. die Einlösungsmodalitäten nicht wesentlich erschweren. Änderungen bzw. Ergänzungen dieser Bedingungen werden unverzüglich gemäß Nr. 11 bekannt gemacht.

(5) Sollte eine Bestimmung dieser Bedingungen ganz oder teilweise unwirksam oder undurchführbar sein oder werden, so bleiben die übrigen Bestimmungen wirksam. Die unwirksame oder undurchführbare Bestimmung ist durch eine wirksame und durchführbare Bestimmung zu ersetzen, die den wirtschaftlichen Zwecken der unwirksamen Bestimmung so weit wie rechtlich möglich Rechnung trägt.

(6) Der Emittent behält sich vor, die Optionsscheine insgesamt, oder einzelne Serien, auch in den Handel an anderen, auch ausländischen Wertpapierbörsen einzuführen sowie die Optionsscheine im Ausland öffentlich anzubieten und in diesem Zusammenhang alle Maßnahmen zu ergreifen, die für die Einführung der Optionsscheine in den Handel an der jeweiligen Börse bzw. ein öffentliches Angebot erforderlich sind. Der Emittent ist hierbei insbesondere berechtigt, dem Optionsscheininhaber die Einlösung der Optionsscheine auch gegenüber einer ausländischen Zahlstelle zu gestatten, den Auszahlungsbetrag in anderer Währung auszuzahlen sowie die Notierung der Optionsscheine in anderer Währung zu beantragen.

Frankfurt am Main, den 16.07.2010

**Citigroup Global Markets
Deutschland AG**

Einlösungserklärung „Frankfurt“ für Mini Future Optionsscheine mit Knock-Out und Gap-Risiko (Muster)

- Vom Optionsscheininhaber ist je WKN eine Einlösungserklärung vollständig auszufüllen -

An: Citigroup Global Markets Deutschland AG
Attn.: Securities
Frankfurter Welle
Reuterweg 16
D-60323 Frankfurt am Main

1. Der Optionsscheininhaber

Name / Firmenbezeichnung

Straße, Hausnr.

PLZ, Ort

Telefon

löst hiermit unwiderruflich gemäß den maßgeblichen Optionsbedingungen folgende Optionsscheine ein:

WKN	ISIN	Anzahl

Die Einlösung soll zum nächsten Berechnungstag erfolgen.

- Die einzulösenden Optionsscheine wurden auf das Konto-Nr. 7098 der Citigroup Global Markets Deutschland AG bei der Clearstream Banking Aktiengesellschaft, Frankfurt am Main oder deren Konto-Nr. 67098 bei Clearstream Banking S.A., Luxemburg übertragen. Mit der Einlösung erlöschen alle mit den Optionsscheinen verbundenen Rechte.
- Der Optionsscheininhaber weist die Citigroup Global Markets Deutschland AG hiermit unwiderruflich an, den Auszahlungsbetrag auf folgendes Konto zu überweisen:

Kontoinhaber (Name / Firmenbezeichnung)

bei Kreditinstitut

Konto-Nr.

BLZ

Swift Code

Wird hier kein Konto oder ein Konto außerhalb der Bundesrepublik Deutschland angegeben, wird dem Optionsscheininhaber auf sein Risiko mit einfacher Post an die in Ziffer 1 angegebene Adresse ein Scheck über den Auszahlungsbetrag übersandt.

- Der Optionsscheininhaber bescheinigt hiermit, daß der Berechtigte aus den Optionsscheinen bei Erwerb der Optionsscheine, bei Unterzeichnung dieser Erklärung und am Tag des Wirksamwerdens der Einlösungserklärung kein Staatsbürger oder Gebietsansässiger der Vereinigten Staaten von Amerika (einschließlich deren Territorien und Besitzungen), keine nach dem Recht der Vereinigten Staaten von Amerika begründete oder organisierte Kapital- oder Personengesellschaft oder sonstige Gesellschaft und kein der Besteuerung der Vereinigten Staaten von Amerika unabhängig von der Quelle seiner Einkünfte unterliegendes Erbschafts- oder Treuhandvermögen ist und daß dieser die Optionsscheine weder zum Zwecke des Weiterverkaufs an United States Personen noch in den Vereinigten Staaten von Amerika erworben hat. Der Optionsscheininhaber bescheinigt weiterhin, dass er die Optionsscheine in Übereinstimmung mit den Verkaufsbeschränkungen der Optionsbedingungen erworben hat. Der Optionsscheininhaber ist mit einer Vorlage dieser Bescheinigung bei allen Behörden und sonstigen staatlichen Stellen (auch außerhalb der Bundesrepublik Deutschland) einverstanden.
- Der Unterzeichnete ist sich bewußt, dass die Einlösung nicht wirksam wird, wenn die Optionsscheine nicht rechtzeitig an die Citigroup Global Markets Deutschland AG übertragen werden oder so übertragen werden, dass eine eindeutige Zuordnung zur Einlösungserklärung nicht möglich ist. Aus diesem Grunde sind bei der Übertragung der Optionsscheine der Name und die Anschrift gemäß Ziffer 1 dieser Einlösungserklärung sowie die Referenz "Optionsschein Einlösung" vollständig anzugeben.

Ort

Datum

Unterschrift(en) des Optionsscheininhabers

Andere endgültige Angebotsbedingungen, die den Teil "E. Beschreibung der Wertpapiere" des Basisprospekts ergänzen:

Bezugnahmen auf Angaben, die durch die endgültigen Angebotsbedingungen im Basisprospekt Nr. 5 auszufüllen bzw. zu ergänzen sind, sind nachfolgend schriftlich ausgeführt. Die nachfolgenden vervollständigten Angaben ergänzen die endgültigen Angebotsbedingungen zum Basisprospekt Nr. 5.

Ausgabeaufschlag, fiktive Managementgebühren
(Bezugnahme unter 3.1 der Wertpapierbeschreibung):

Nicht anwendbar

Währung der Wertpapieremission

Euro.

Beschluss, der die Grundlage für die Neuemission bildet
(Bezugnahme unter 4.1.8 der Wertpapierbeschreibung):

Gemäß einem Beschluss der bei dem Emittenten für die Neuemission zuständigen Personen vom 16.07.2010.

Angebotsmethode, Anbieter und Emissionstermin der Wertpapiere
(Bezugnahme unter 4.1.9 der Wertpapierbeschreibung):

Angebotsregion:

Alle Optionsscheine, auf die in diesen endgültigen Angebotsbedingungen Bezug genommen wird, werden ausschließlich in der Bundesrepublik Deutschland angeboten.

Angebotsmethode:

In Deutschland werden die Optionsscheine ab dem ersten Tag des Angebots in einem freihändigen, fortlaufenden Angebot bis zum Delisting Tag angeboten. Dabei werden die Angebotspreise vom Emittenten kontinuierlich, d.h. jederzeit, an sich ändernde Marktverhältnisse angepasst.

Eine Kauforder können Sie über Ihre Depotbank entweder außerbörslich direkt mit dem Emittenten oder über eine der Börsen ausführen lassen, an denen die Optionsscheine zum Handel notiert werden. Der Emittent wird sich nach besten Möglichkeiten bemühen, die Zulassung zum Börsenhandel an den unten genannten Börsenplätzen zum frühest möglichen Zeitpunkt sicherzustellen.

Da die Angebotspreise fortlaufend festgelegt werden, sollten Sie sich vor Ordervergabe über den aktuellen Preis über die Kursinformationsmedien des Emittenten informieren. Bei einer unlimitierten Order gibt Ihnen dieser aktuelle Preis einen Anhaltspunkt für den Preis, zu dem Ihre Order endgültig abgerechnet wird. Abhängig von dem Zeitraum, den die Ausführung Ihrer Order dauert, kann der Preis zwischen Ihrer Ordervergabe und Abrechnung daher sowohl nach oben wie nach unten schwanken. Ziehen Sie daher die Vergabe einer limitierten Börsenorder in Betracht, bei der festgelegt wird, wie viel Sie maximal für einen einzelnen Optionsschein der betreffenden Gattung zahlen möchten.

Limite werden von dem elektronischen Handelssystem des Emittenten nicht unterstützt. Andererseits ermöglicht dieses Handelssystem einen Abschluss zu dem vom System angezeigten Verkaufspreis, sofern der Abschluss innerhalb weniger Sekunden nach Kursanfrage bestätigt wird. Informieren Sie sich daher bei Ihrer Depotbank, ob diese an das elektronische Handelssystem des Emittenten angeschlossen ist.

Keine Übernahmegruppe:

Die Wertpapiere werden nicht im Rahmen einer begrenzten Zeichnungsfrist angeboten und von keiner dritten Partei übernommen oder von einer Übernahmegruppe übernommen, sondern freibleibend vom Emittenten bis zur Einstellung des Börsenhandels angeboten.

Anbieter:

Der Anbieter der Wertpapiere ist der Emittent.

Emissionstermin:

Der erste Tag des Angebots ist der 19.07.2010.
Der erste Tag der Valutierung (definiert als der Tag, an dem der Inhaber-Sammeloptionsschein bei dem Wertpapier-Zentralverwahrer hinterlegt wird) ist der 21.07.2010.

Die Bedingungen (nicht die Optionsbedingungen), denen das Angebot unterliegt

(Bezugnahme unter 5.1.1 der Wertpapierbeschreibung):

In Deutschland werden die Optionsscheine vom Emittenten ab dem ersten Tag des Angebots in einem freihändigen, fortlaufenden Angebot bis zum Delisting Tag angeboten. Dabei werden die Angebotspreise vom Emittenten kontinuierlich, d.h. jederzeit, an sich ändernde Marktverhältnisse angepasst. Die Wertpapiere werden nicht im Rahmen einer begrenzten Zeichnungsfrist angeboten und von keiner dritten Partei übernommen oder von einer Übernahmegruppe übernommen, sondern freibleibend vom Emittenten bis zur Einstellung des Börsenhandels angeboten. Der Emittent behält sich jedoch vor, eine Kauforder teilweise oder ganz zu bedienen. Im Falle der Ausführung einer Order über eine Börse gegenüber der der Emittent eine freiwillige Verpflichtung zur Stellung von An- und Verkaufspreisen übernommen hat, kann der Emittent gegenüber der betreffenden Börse zur Stellung von bestimmten Minimalvolumina in Geld oder Stücken bzw. maximalen Spreads zwischen An- und Verkaufspreisen verpflichtet sein. Siehe auch Gliederungspunkt „Institute, die eine market making Verpflichtung übernommen haben; Beschreibung der market making Verpflichtung (Bezugnahme unter 6.3 der Wertpapierbeschreibung)“.

Die Gesamtsumme des Angebots

(Bezugnahme unter 5.1.2 der Wertpapierbeschreibung):

Die Optionsscheine werden bis zu einer Gesamtsumme angeboten, die in Tabelle 1 der betreffenden Optionsbedingungen ("Anzahl") angegeben ist, zuzüglich einer eventuellen Erhöhung der Anzahl der Wertpapiere. Anleger können jederzeit bis zu dem Tag des Delisting jede Anzahl der Wertpapiere bis zu der Gesamtanzahl der emittierten Wertpapiere erwerben, vorbehaltlich eines zwischenzeitlichen Ausverkaufs der betreffenden Wertpapiere. Der Emittent behält sich vor, einen Kaufauftrag eines Anlegers zum Erwerb der Wertpapiere ganz oder teilweise auszuführen. Der Emittent behält sich ferner das Recht vor, die Anzahl der Wertpapiere jederzeit zu erhöhen.

Die Angebotsfrist und das Zeichnungsverfahren

(Bezugnahme unter 5.1.3 der Wertpapierbeschreibung):

Siehe Ziffer 4.1.9.

Beschreibung von Indizes, die nicht vom Emittenten verfasst sind

(Bezugnahme unter 4.2.2. c) der Wertpapierbeschreibung):

Nicht anwendbar

Aktuelle Zusammensetzung der Indizes, die nicht vom Emittenten verfasst sind

(Bezugnahme unter 4.2.2. e) der Wertpapierbeschreibung):

Nicht anwendbar

Beschreibung der Indizes und Körbe, die vom Emittenten verfasst sind

(Bezugnahme unter 4.2.2 d) der Wertpapierbeschreibung):

Nicht anwendbar.

Informationen über die vergangene und weitere Wertentwicklung des Basiswertes und seiner Volatilität

(Bezugnahme unter 4.2.2 b) der Wertpapierbeschreibung):

Charts, die aktuelle Informationen zur historischen Kursentwicklung und Volatilität des Basiswertes, auf den sich die Optionsscheine beziehen, wiedergeben, sind auf der Internetseite des Emittenten erhältlich:

<http://www.citifirst.com>

Die Einzelheiten zum Mindest- und/oder Höchstbetrag der Zeichnung;

(Bezugnahme unter 5.1.4 der Wertpapierbeschreibung):

Vorbehaltlich der Gesamtsumme der Wertpapiere einer Wertpapierkennnummer, wird jeder Optionsschein ohne Beschränkung durch eine Höchstanzahl oder einen Höchstbetrag des Wertes einer entsprechenden Order angeboten. Die minimale Ordermenge entspricht einem Optionsschein. Grundsätzlich kann jegliche Anzahl von Optionsscheinen einer Klasse geordert bzw. gezeichnet, bedient und abgerechnet werden.

Die Methode und Fristen für die Bezahlung der Wertpapiere und ihre Lieferung

(Bezugnahme unter 5.1.5 der Wertpapierbeschreibung):

Der Emittent behält sich das Recht vor, unmittelbar bei ihm eingereichte Order bzw. Zeichnungen hinsichtlich der betreffenden Anzahl einer Wertpapierkategorie ganz oder teilweise außerbörslich (in Ländern, in denen dies gesetzlich zulässig ist) auszuführen.

Von Anlegern an einer in diesem Dokument angegebenen Wertpapierbörse platzierte Order bzw. Zeichnungen müssen von dem Emittenten lediglich bis zu einer bestimmten Höchstanzahl der Wertpapiere ausgeführt werden, zu deren Ausführung der Emittent sich in Erfüllung seiner market maker Verpflichtungen gegenüber der betreffenden Wertpapierbörse verpflichtet hat. Für Einzelheiten siehe weiter unten "Institute, die eine market making Verpflichtung übernommen haben; Beschreibung der market making Verpflichtung" (Bezugnahme unter 6.3 der Wertpapierbeschreibung).

Die Lieferung der Wertpapiere erfolgt in der Bundesrepublik Deutschland üblicherweise innerhalb von zwei Bankgeschäftstagen, erstmalig aber am ersten Tag der Valutierung.

Der erste Tag der Valutierung der angebotenen Optionsscheine ist der:
21.07.2010

Art, Weise, Termin der Offenlegung der Ergebnisse des Angebots

(Bezugnahme unter 5.1.6 der Wertpapierbeschreibung):

Da die Wertpapiere nicht von einem oder einer Gruppe von Unternehmen übernommen werden, sondern von dem Emittenten freihändig und fortlaufend bis zum Laufzeitende der Wertpapiere angeboten werden, wird der Emittent die zu einem gegebenen Zeitpunkt ausstehende Anzahl der Wertpapiere nicht veröffentlichen.

Aktuelle Informationen hinsichtlich der vom Emittenten zu einem gegebenen Zeitpunkt gestellten An- und Verkaufspreise werden weiter unten unter "Methode der Preisfestsetzung, Verfahren der Preisveröffentlichung, Kosten und Steuern beim Erwerb" (Bezugnahme unter 5.3 der Wertpapierbeschreibung) dargestellt.

Potentielle Investorengruppen, Angebot in mehreren Ländern, Vorbehalt von Tranchen für einzelne Länder

(Bezugnahme unter 5.2.1 der Wertpapierbeschreibung):

Die Wertpapiere werden allen Investorengruppen zum Kauf angeboten.

Die in diesen endgültigen Angebotsbedingungen in Bezug genommenen Wertpapiere werden ausschließlich innerhalb der Bundesrepublik Deutschland angeboten.

Mitteilung der Zuteilung an Zeichner und, ob Handelsaufnahme vor dieser Mitteilung möglich ist

(Bezugnahme unter 5.2.2 der Wertpapierbeschreibung):

Da die Wertpapiere fortlaufend angeboten werden, wird der Emittent jeweils entscheiden, ob er die Gesamtanzahl einer bestimmten außerbörslichen Kauforder (in Ländern, in denen dies gesetzlich zulässig ist) ausführen möchte. Der Emittent ist berechtigt, eine solche außerbörsliche Kauforder (in Ländern, in denen dies gesetzlich zulässig ist) ganz oder nur teilweise auszuführen. Die Person, die eine solche Kauforder aufgegeben hat, wird durch die Ausführung der Abrechnung über das ausgeführte Volumen seiner Kauforder in Kenntnis gesetzt werden.

Der außerbörsliche Handel in Optionsscheinen (in Ländern, in denen dies gesetzlich zulässig ist) beginnt am Tag des ersten Angebots. Aufgrund der fortlaufenden Preisfestsetzung wird der außerbörsliche Handel (in Ländern, in denen dies gesetzlich zulässig ist) in den Optionsscheinen zu dem Zeitpunkt bereits begonnen haben, an dem Ihre Order aufgegeben wurde.

Der Emittent beabsichtigt einen Zulassungsantrag hinsichtlich der Optionsscheine zum Handel an den unten angeführten Wertpapierbörsen so früh wie möglich zu stellen. Der Handel in den Optionsscheinen an solchen Wertpapierbörsen wird voraussichtlich frühestens am Tag des ersten Angebots oder eventuell ein paar Tage nach dem Tag des ersten Angebots beginnen.

Kriterien bzw. Bedingungen für die Festlegung des Angebotspreises und des Emissionsvolumens

(Bezugnahme unter 5.5 der Wertpapierbeschreibung):

Kriterien bzw. Bedingungen für die Festlegung des Angebotspreises:

In Deutschland werden die Optionsscheine ab dem ersten Tag des Angebots in einem freihändigen, fortlaufenden Angebot bis zum letzten Tag der Laufzeit angeboten. Dabei werden die Angebotspreise vom Emittenten kontinuierlich, d.h. jederzeit, an sich ändernde Marktverhältnisse angepasst. Zur Methode der Preisfestsetzung siehe auch „5.3 Methode der Preisfestsetzung, Verfahren der Preisveröffentlichung, Kosten und Steuern beim Erwerb“ in der Wertpapierbeschreibung des Basisprospektes bzw. dieser endgültigen Angebotsbedingungen. Optionsscheine können außerbörslich direkt beim Emittenten gekauft werden. Eine weitere Möglichkeit besteht in der Aufgabe einer Kauforder über eine der Börsen, an denen die Wertpapiere notiert werden (sofern bereits vorhanden).

Emissionsvolumen:

Die Optionsscheine werden jeweils in der in Tabelle 1 der individuellen Ausstattungsmerkmale dieser endgültigen Angebotsbedingungen genannten Anzahl angeboten. Die Mindestordergröße beträgt jeweils ein Optionsschein. Eine maximale Obergrenze besteht für eine Kauforder vorbehaltlich des Gesamtvolumens der Emission grundsätzlich nicht; der Emittent behält sich vor, im Rahmen seiner Kursstellung außerbörsliche Kauforders mit einer geringeren als der geordneten Anzahl zu bedienen. Bei Kauforders über die Börse behält sich der Emittent die indirekte bzw. direkte Bedienung bis zur „Minimalgröße“ vor; vgl. auch „Beschreibung der market making Verpflichtung“ weiter unten.

Methode der Preisfestsetzung, Verfahren der Preisveröffentlichung, Kosten und Steuern beim Erwerb

(Bezugnahme unter 5.3 der Wertpapierbeschreibung):

Methode der Preisfestsetzung:

Grundsätzlich wird die Preisfestsetzung während der Laufzeit der Optionsscheine vom Emittenten vorgenommen. Der Emittent nutzt zur Preisermittlung Modelle, die verschiedene Einflussfaktoren berücksichtigen, die in dem zu diesen endgültigen Angebotsbedingungen gehörigen Basisprospekt im Teil „E. Wertpapierbeschreibung“ unter „2. Risikofaktoren“ und „4.1.2 Einfluss des Basiswerts auf die Wertpapiere“ erläutert werden.

Anfängliche Angebotspreise:

Die Optionsscheine werden vom Emittenten freibleibend ab dem 19.07.2010 angeboten. Auf der Grundlage der Referenzkurse der Basiswerte betragen die anfänglichen Verkaufspreise am ersten Angebotstag:

ISIN	Basiswert	Referenzkurs des Basiswertes		Anfänglicher Preis	
DE000CG9TKC5	<u>Deutsche Bank</u>	EUR	48.91	EUR	0.33
DE000CG9TKD3	<u>Lanxess</u>	EUR	36.84	EUR	0.54
DE000CG9TKE1	<u>RWE</u>	EUR	53.17	EUR	0.60
DE000CG9TKF8	<u>Adobe</u>	USD	28.22	EUR	0.42
DE000CG9TKG6	<u>Adobe</u>	USD	28.22	EUR	0.35
DE000CG9TKH4	<u>Adobe</u>	USD	28.22	EUR	0.31
DE000CG9TKJ0	<u>Advanced Micro Devices</u>	USD	7.41	EUR	0.37
DE000CG9TKK8	<u>AIG</u>	USD	37.38	EUR	0.43
DE000CG9TKL6	<u>AIG</u>	USD	37.38	EUR	0.36
DE000CG9TKM4	<u>Akamai</u>	USD	44.23	EUR	0.42
DE000CG9TKN2	<u>Altria Group</u>	USD	21.46	EUR	0.21
DE000CG9TKP7	<u>Altria Group</u>	USD	21.46	EUR	0.29
DE000CG9TKQ5	<u>Altria Group</u>	USD	21.46	EUR	0.45
DE000CG9TKR3	<u>Amazon.com</u>	USD	122.06	EUR	1.87
DE000CG9TKS1	<u>Amazon.com</u>	USD	122.06	EUR	1.49
DE000CG9TKT9	<u>Amazon.com</u>	USD	122.06	EUR	1.10
DE000CG9TKU7	<u>Apple Computer</u>	USD	251.45	EUR	1.51
DE000CG9TKV5	<u>AT&T</u>	USD	25.00	EUR	0.52
DE000CG9TKW3	<u>BAIDU.COM</u>	USD	75.64	EUR	1.47
DE000CG9TKX1	<u>BAIDU.COM</u>	USD	75.64	EUR	1.09
DE000CG9TKY9	<u>Bank of America</u>	USD	15.39	EUR	0.20
DE000CG9TKZ6	<u>Caterpillar</u>	USD	66.51	EUR	0.75
DE000CG9TLA7	<u>Chesapeake</u>	USD	21.44	EUR	0.33
DE000CG9TLB5	<u>Cisco Systems</u>	USD	23.92	EUR	0.25
DE000CG9TLC3	<u>Cognizant</u>	USD	54.16	EUR	0.53
DE000CG9TLD1	<u>ConocoPhillips</u>	USD	52.86	EUR	0.43
DE000CG9TLE9	<u>eBay</u>	USD	21.03	EUR	0.25
DE000CG9TLF6	<u>Electronic Arts</u>	USD	15.49	EUR	0.21
DE000CG9TLG4	<u>EMC</u>	USD	20.58	EUR	0.30
DE000CG9TLH2	<u>EMC</u>	USD	20.58	EUR	0.22
DE000CG9TLJ8	<u>General Electric</u>	USD	15.25	EUR	0.19
DE000CG9TLK6	<u>Goldman Sachs</u>	USD	145.22	EUR	0.95
DE000CG9TLL4	<u>Goldman Sachs</u>	USD	145.22	EUR	0.76
DE000CG9TLM2	<u>Google</u>	USD	494.02	EUR	2.83
DE000CG9TLN0	<u>Hartford Financial Services</u>	USD	22.78	EUR	0.43
DE000CG9TLP5	<u>Hartford Financial Services</u>	USD	22.78	EUR	0.23
DE000CG9TLQ3	<u>Hartford Financial Services</u>	USD	22.78	EUR	0.31
DE000CG9TLR1	<u>Hewlett-Packard</u>	USD	47.42	EUR	0.40
DE000CG9TLS9	<u>IBM</u>	USD	130.72	EUR	1.31
DE000CG9TLT7	<u>Intel</u>	USD	21.51	EUR	0.29
DE000CG9TLU5	<u>Intel</u>	USD	21.51	EUR	0.21
DE000CG9TLV3	<u>Juniper Networks</u>	USD	26.86	EUR	0.36
DE000CG9TLW1	<u>Juniper Networks</u>	USD	26.86	EUR	0.28
DE000CG9TLX9	<u>Marvell Technology</u>	USD	17.35	EUR	0.20
DE000CG9TLY7	<u>Micron Technology</u>	USD	8.66	EUR	0.47
DE000CG9TLZ4	<u>Monsanto</u>	USD	56.03	EUR	1.18
DE000CG9TMA5	<u>Monsanto</u>	USD	56.03	EUR	0.79
DE000CG9TMB3	<u>Motorola</u>	USD	7.72	EUR	0.68
DE000CG9TMC1	<u>Motorola</u>	USD	7.72	EUR	0.49
DE000CG9TMD9	<u>NetApp</u>	USD	40.73	EUR	0.35
DE000CG9TME7	<u>Oracle</u>	USD	23.83	EUR	0.24
DE000CG9TMF4	<u>Pfizer</u>	USD	14.87	EUR	0.16
DE000CG9TMG2	<u>Qualcomm</u>	USD	36.88	EUR	0.59
DE000CG9TMH0	<u>Qualcomm</u>	USD	36.88	EUR	0.43
DE000CG9TMJ6	<u>Qualcomm</u>	USD	36.88	EUR	0.36
DE000CG9TMK4	<u>Rambus</u>	USD	18.84	EUR	0.24
DE000CG9TML2	<u>Research in Motion</u>	USD	55.64	EUR	0.69
DE000CG9TMM0	<u>Salesforce.com</u>	USD	95.99	EUR	1.18
DE000CG9TMN8	<u>Salesforce.com</u>	USD	95.99	EUR	0.79
DE000CG9TMP3	<u>Salesforce.com</u>	USD	95.99	EUR	2.18
DE000CG9TMQ1	<u>SanDisk</u>	USD	43.97	EUR	0.40
DE000CG9TMR9	<u>Scientific Games</u>	USD	10.43	EUR	0.17
DE000CG9TMS7	<u>Sohu</u>	USD	42.85	EUR	0.43

<u>DE000CG9TMT5</u>	<u>Starbucks</u>	<u>USD</u>	<u>26.13</u>	<u>EUR</u>	<u>0.26</u>
<u>DE000CG9TMU3</u>	<u>Starbucks</u>	<u>USD</u>	<u>26.13</u>	<u>EUR</u>	<u>0.24</u>
<u>DE000CG9TMV1</u>	<u>SunPower</u>	<u>USD</u>	<u>13.98</u>	<u>EUR</u>	<u>0.33</u>
<u>DE000CG9TMW9</u>	<u>SunPower</u>	<u>USD</u>	<u>13.98</u>	<u>EUR</u>	<u>0.25</u>
<u>DE000CG9TMX7</u>	<u>Suntech Power</u>	<u>USD</u>	<u>10.84</u>	<u>EUR</u>	<u>0.24</u>
<u>DE000CG9TMY5</u>	<u>Suntech Power</u>	<u>USD</u>	<u>10.84</u>	<u>EUR</u>	<u>0.20</u>
<u>DE000CG9TMZ2</u>	<u>Suntech Power</u>	<u>USD</u>	<u>10.84</u>	<u>EUR</u>	<u>0.16</u>
<u>DE000CG9TNA3</u>	<u>Symantec</u>	<u>USD</u>	<u>14.92</u>	<u>EUR</u>	<u>0.17</u>
<u>DE000CG9TNB1</u>	<u>Tessera</u>	<u>USD</u>	<u>16.34</u>	<u>EUR</u>	<u>0.28</u>
<u>DE000CG9TNC9</u>	<u>Tessera</u>	<u>USD</u>	<u>16.34</u>	<u>EUR</u>	<u>0.20</u>
<u>DE000CG9TND7</u>	<u>Tessera</u>	<u>USD</u>	<u>16.34</u>	<u>EUR</u>	<u>0.22</u>
<u>DE000CG9TNE5</u>	<u>Tessera</u>	<u>USD</u>	<u>16.34</u>	<u>EUR</u>	<u>0.30</u>
<u>DE000CG9TNF2</u>	<u>Texas Instruments</u>	<u>USD</u>	<u>25.40</u>	<u>EUR</u>	<u>0.24</u>
<u>DE000CG9TNG0</u>	<u>Trina Solar</u>	<u>USD</u>	<u>21.98</u>	<u>EUR</u>	<u>0.37</u>
<u>DE000CG9TNH8</u>	<u>Trina Solar</u>	<u>USD</u>	<u>21.98</u>	<u>EUR</u>	<u>0.29</u>
<u>DE000CG9TNJ4</u>	<u>Trina Solar</u>	<u>USD</u>	<u>21.98</u>	<u>EUR</u>	<u>0.21</u>
<u>DE000CG9TNK2</u>	<u>Vale</u>	<u>USD</u>	<u>24.99</u>	<u>EUR</u>	<u>0.60</u>
<u>DE000CG9TNL0</u>	<u>Vale</u>	<u>USD</u>	<u>24.99</u>	<u>EUR</u>	<u>0.37</u>

Verfahren der Preisveröffentlichung:

Die fortlaufend vom Emittenten gestellten An- bzw. Verkaufskurse werden durch die folgenden Kursinformationsmedien in Deutschland mit einer zeitlichen Verzögerung von wenigen Minuten veröffentlicht:

Internet:
www.citifirst.com

Kosten und Steuern beim Erwerb:

Vom Emittenten werden den Optionsscheininhabern weder beim außerbörslichen (in Ländern, in denen dies gesetzlich zulässig ist) noch beim Erwerb der Optionsscheine über eine Börse irgendwelche Kosten oder Steuern abgezogen. Davon sind die Gebühren und Kosten zu unterscheiden, die dem Optionsscheinerwerber von seiner Bank für die Ausführung der Wertpapierorder in Rechnung gestellt werden und auf der Abrechnung des Erwerbsgeschäftes in der Regel neben dem Preis der Optionsscheine getrennt ausgewiesen werden. Letztere Kosten hängen ausschließlich von den individuellen Konditionen der Bank des Optionsscheinerwerbers ab. Bei einem Kauf über eine Börse kommen zusätzlich weitere Gebühren und Spesen hinzu. Darüber hinaus werden den Optionsscheininhabern in der Regel von ihrer Bank jeweils individuelle Gebühren für die Depotführung in Rechnung gestellt. Unbeschadet vom vorgenannten können Gewinne aus Optionsscheinen einer Gewinnbesteuerung bzw. das Vermögen aus den Optionsscheinen der Vermögensbesteuerung unterliegen.

Name und Anschrift des Koordinators des Angebots und der Platziierer in den einzelnen Ländern des Angebots

(Bezugnahme unter 5.4.1 der Wertpapierbeschreibung):

In Deutschland wird das Angebot der Optionsscheine vom Emittenten koordiniert. Name und Adresse des Emittenten lauten: Citigroup Global Markets Deutschland AG, Frankfurter Welle, Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main.

Eine spezielle Übernahme- oder Platzierungsgruppe gibt es nicht. Die Optionsscheine können von interessierten Anlegern jederzeit grundsätzlich über jede Depotbank in Deutschland bzw. jede im Ausland ansässige Bank in Übereinstimmung mit den einschlägigen gesetzlichen Regelungen bzw. den Optionsbedingungen geordert werden.

Name und Anschrift der Zahlstellen und der Wertpapiersammelbanken in jedem Land
(Bezugnahme unter 5.4.2 der Wertpapierbeschreibung):

Citigroup Global Markets Deutschland AG
Frankfurter Welle
Reuterweg 16
D-60323 Frankfurt am Main

Die Inhaber-Sammeloptionsscheine werden vom Emittenten bei der Clearstream Banking Aktiengesellschaft, Neue Börsenstrasse 8, 60487 Frankfurt am Main hinterlegt.

Übernahme, Platzierung, Übernahme- bzw. Platzierungsprovisionen
(Bezugnahme unter 5.4.3 der Wertpapierbeschreibung):

Die Optionsscheine werden von Dritten weder übernommen, noch durch eine bestimmte Gruppe nach besten Möglichkeiten platziert. Kauforders werden vielmehr von jeder beliebigen Bank wie bei jedem anderen außerbörslichen oder Börsengeschäft entgegengenommen. Provisionen werden für solche Kauforders vom Emittenten an Depotbanken von Kunden nicht gezahlt.

Abschlussdatum des Übernahmevertrages, sofern vorhanden
(Bezugnahme unter 5.4.4 der Wertpapierbeschreibung):

Ein Übernahmevertrag besteht nicht.

Name und Anschrift der Berechnungsstellen
(Bezugnahme unter 5.4.5 der Wertpapierbeschreibung):

Citigroup Global Markets Deutschland AG
Frankfurter Welle
Reuterweg 16
D-60323 Frankfurt am Main

Zulassung der Wertpapiere an einem geregelten Börsenmarkt

(Bezugnahme unter 6.1 der Wertpapierbeschreibung):

Der Emittent wird die Zulassung sämtlicher Serien der Optionsscheine zum regulierten Markt an der Börse Stuttgart sowie die Einbeziehung in die Preisfeststellung des Scoach SmartTrading Segmentes im Freiverkehr an der Frankfurter Wertpapierbörse beantragen.

Der frühest mögliche Handelstag im regulierten Markt an der Börse Stuttgart ist der erste Tag der Valutierung.

Der frühest mögliche Handelstag im Scoach SmartTrading Segment des Freiverkehrs an der Frankfurter Wertpapierbörse ist der spätere Tag von entweder dem ersten Tag des Angebots oder dem zweiten Börsentag vor dem ersten Tag der Valutierung.

Geregelte Börsenmärkte oder gleichwertige Märkte, an denen die Wertpapiere bereits zugelassen sind

(Bezugnahme unter 6.2 der Wertpapierbeschreibung):

Gegenwärtig werden die Optionsscheine ausschließlich an den unter 6.1 angeführten Börsen notiert.

Institute, die eine market making Verpflichtung übernommen haben; Beschreibung der market making Verpflichtung

(Bezugnahme unter 6.3 der Wertpapierbeschreibung):

Der Emittent, Citigroup Global Markets Deutschland AG, Frankfurter Welle, Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main, hat gegenüber den oben genannten Börsen eine freiwillige Verpflichtung zur Stellung von Ankauf- und Verkaufskursen für bestimmte Auftrags- oder Wertpapiervolumina unter zumutbaren Marktbedingungen übernommen. Eine derartige Verpflichtung gilt jedoch lediglich gegenüber der beteiligten Börse. Dritte Personen, wie die Optionsscheininhaber, können daraus keine Verpflichtung des Emittenten Ihnen gegenüber ableiten. Weiterhin gilt die Verpflichtung gegenüber der Börse nicht in Ausnahmesituationen wie technischen Betriebsstörungen im Bereich des Emittenten (z.B. Telefonstörung, technische Störung, Stromausfall) oder besonderen Marktsituationen (z.B. außerordentliche Marktbewegung des Basiswertes, besondere Situationen am Heimatmarkt des Basiswertes oder besondere Vorkommnisse bei der Preisfeststellung in dem als Basiswert berücksichtigten Finanzinstrument) oder besonderen Marktsituationen aufgrund gravierender Störungen der wirtschaftlichen und politischen Lage (z.B. Terroranschläge, Crash-Situationen) oder dem vorübergehenden Ausverkauf der Emission; im letzten Fall muss nur ein Ankaufkurs und es darf kein Verkaufskurs bereitgestellt werden. Siehe auch „D. Risikofaktoren der Wertpapiere“ im Basisprospekt.

Haftungsausschluss mit Blick auf Aktien als Basiswerte:

Soweit Aktien als Basiswerte von Optionsscheinen/Zertifikaten der Citigroup Global Markets Deutschland AG (die "Emittentin") dienen, wie in diesen Endgültigen Bedingungen beschrieben, stellt dies keine Empfehlung der jeweiligen Aktiengesellschaft auf deren Aktien die Optionsscheine/Zertifikate bezugnehmen dar, die Optionsscheine/Zertifikate der Emittentin zu kaufen oder zu verkaufen. Die jeweilige Aktiengesellschaft übernimmt keine Haftung für die Optionsscheine/Zertifikate der Emittentin. Die Optionsscheine/Zertifikate sind allein Verbindlichkeiten der Emittentin und nicht der jeweiligen Aktiengesellschaft. Auch stellen diese Endgültigen Bedingungen kein Angebot zum Kauf oder Verkauf von Aktien der jeweiligen Aktiengesellschaft dar. Die jeweilige Aktiengesellschaft ist in keiner Weise in die Emission, den Zeitpunkt der Emission, die Erstellung dieser Endgültigen Bedingungen oder die Begründung irgendwelcher Rechte unter den Optionsscheinen/Zertifikaten der Emittentin eingebunden. Auch hat ein Gläubiger der Optionsscheine/Zertifikate der Emittentin aus den Optionsscheinen/Zertifikaten keinerlei Rechte gegen die jeweilige Aktiengesellschaft auf Informationen, Stimmrechten oder Dividendenzahlungen.

Frankfurt am Main, 16.07.2010

Citigroup Global Markets Deutschland AG