

**BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH,**

**Frankfurt am Main**

**Endgültige Angebotsbedingungen Nr. 167**

**vom 19. Oktober 2016**

**Im Zusammenhang mit dem Basisprospekt vom 26. Januar 2016 zur Begebung von Zertifikaten, Aktienanleihen, Anleihen bezogen auf Indizes, Aktien, Metalle, Futureskontrakte, Rohstoffe, börsennotierte Fondsanteile, nicht börsennotierte Fondsanteile, Währungswechselkurse, Referenzsätze, American Depositary Receipts und/oder Global Depositary Receipts sowie einen Korb von Indizes, Aktien, Metallen, Futureskontrakten, Rohstoffen, börsennotierten Fondsanteilen, nicht börsennotierten Fondsanteilen, Währungswechselkursen, Referenzsätzen, American Depositary Receipts und/oder Global Depositary Receipts**

**zur Begebung von**

**Capped Bonus bzw. Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikaten**

**bezogen auf Futureskontrakte**

**angeboten durch**

**BNP Paribas Arbitrage S.N.C.,**

**Paris, Frankreich**

Dieses Dokument enthält die endgültigen Angaben zu den Wertpapieren und die Endgültigen Wertpapierbedingungen und stellt die Endgültigen Bedingungen des Angebotes von Capped Bonus bzw. Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikaten bezogen auf Futureskontrakte (im Nachfolgenden auch als "Basiswert" bezeichnet) dar.

Die Wertpapierbedingungen für die betreffende Serie sind in einen Abschnitt A (Produktspezifische Bedingungen) und einen Abschnitt B (Allgemeine Bedingungen) aufgeteilt. Der Abschnitt A der Wertpapierbedingungen ist durch die nachfolgenden Endgültigen Bedingungen vervollständigt. Der Abschnitt B der Wertpapierbedingungen ist bereits vollständig im Basisprospekt im Abschnitt X. Wertpapierbedingungen aufgeführt.

Die Endgültigen Bedingungen wurden für die Zwecke des Artikels 5 Absatz 4 der Richtlinie 2003/71/EG, geändert durch die Richtlinie 2010/73/EU, abgefasst. Die Endgültigen Bedingungen sind zusammen mit dem Basisprospekt vom 26. Januar 2016 (wie nachgetragen durch die Nachträge vom 22. April 2016, vom 12. Mai 2016, vom 22. Juli 2016 und vom 8. August 2016 einschließlich etwaiger zukünftiger Nachträge) und einschließlich der durch Verweis einbezogenen Dokumente zu lesen.

Den Endgültigen Bedingungen ist eine Zusammenfassung für die einzelne Emission angefügt.

Der Basisprospekt, die durch Verweis einbezogenen Dokumente, und etwaige Nachträge zum Basisprospekt sowie die Endgültigen Bedingungen sind am Sitz der Emittentin, Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main kostenlos erhältlich und können auf der Webseite [derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte](http://derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte) bzw. die Endgültigen Bedingungen auf der Website [derivate.bnpparibas.com/zertifikate](http://derivate.bnpparibas.com/zertifikate) abgerufen werden. Um sämtliche Angaben zu erhalten, ist der Basisprospekt einschließlich der durch Verweis einbezogenen Dokumente und etwaiger Nachträge in Zusammenhang mit den Endgültigen Bedingungen zu lesen.

Soweit in diesem Dokument nicht anders definiert oder geregelt, haben die in diesem Dokument verwendeten Begriffe die ihnen im Basisprospekt zugewiesene Bedeutung.

Die Endgültigen Bedingungen stellen für die betreffende Serie von Wertpapieren die endgültigen Wertpapierbedingungen dar (die "Endgültigen Wertpapierbedingungen"). Sofern und soweit die im Basisprospekt enthaltenen Wertpapierbedingungen von den Endgültigen Wertpapierbedingungen abweichen, sind die Endgültigen Wertpapierbedingungen maßgeblich.

## **ANGABEN ÜBER DEN BASISWERT**

Der den Wertpapieren zugewiesene Basiswert ist der Tabelle in den Wertpapierbedingungen (§ 1) zu entnehmen. Nachfolgender Tabelle sind der Basiswert sowie die öffentlich zugängliche Internetseite, auf der derzeit Angaben in Bezug auf die Wert- und Kursentwicklung abrufbar sind, zu entnehmen.

<b>Basiswert</b>	<b>Internetseite</b>
ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil"	<a href="http://www.theice.com">www.theice.com</a>
NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte	<a href="http://www.cmegroup.com">www.cmegroup.com</a>

### **ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte „Brent Crude Oil“**

Der Basiswert, der ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte „Brent Crude Oil“ (ICE Brent Crude Futures Contract), im Folgenden auch als "Kontrakt(e)" bezeichnet, ist ein an der Intercontinental Exchange, Inc. ("ICE"), London gehandelter Futureskontrakt bezogen auf Rohöl der Sorte Brent (Qualität gemäß dem Pipeline-Austritt in Sullom Voe).

ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte „Brent Crude Oil“ sind Verträge, die auf physischer Lieferung von Rohöl, mit der Möglichkeit zum Barausgleich basieren. Eine Beschreibung der Verträge ist auf der Webseite der ICE ([www.theice.com](http://www.theice.com)), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: *Products*, zu finden.

Es wird darauf hingewiesen, dass die ICE in keiner Weise in die Emission der Wertpapiere und/oder ihren Vertrieb involviert ist. Weder hat die ICE der Nutzung des Basiswertes für den Zweck dieses Wertpapiers noch seiner Bezugnahme in diesem Dokument zugestimmt, noch bestehen irgendwelche Pflichten (gleich aus welchem Rechtsgrund) der ICE gegenüber den Wertpapierinhabern im Zusammenhang mit dem Basiswert.

#### **a) Einheit je Vertrag**

1.000 Barrels (U.S.) = 42.000 Gallonen (U.S.) = 158.987 Liter

#### **b) Notierung**

Die Notierung erfolgt in US Dollar und Cent pro Barrel.

Weitere Informationen, wie zum Beispiel Laufzeit, Handel, letzter Handelstag, Preisfestsetzung und Preisveränderungen, können im Internet auf der Webseite der ICE ([www.theice.com](http://www.theice.com)), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: *Products*, abgerufen werden.

### **NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte**

Der Basiswert, der NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakt, im Folgenden auch als "Kontrakt(e)" bezeichnet, ist ein an der New York Mercantile Exchange, Inc. ("NYMEX") gehandelter Vertrag bezogen auf die zukünftige Lieferung von leichtem Qualitätsrohöl, das in Oklahoma oder Texas produziert wird.

WTI Futureskontrakte sind Verträge auf die zukünftige Lieferung von "Light, sweet crude oil" ("leichtes Qualitätsrohöl"). Eine Beschreibung der Verträge ist auf der Webseite der NYMEX ([www.cmegroup.com](http://www.cmegroup.com)), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: *Products & Trading*, zu finden.

Es wird darauf hingewiesen, dass die NYMEX in keiner Weise in die Emission der Wertpapiere und/oder ihren Vertrieb involviert ist. Weder hat die NYMEX der Nutzung des Basiswertes für den Zweck dieser Wertpapiere noch seiner Bezugnahme in diesem Dokument zugestimmt, noch bestehen irgendwelche Pflichten (gleich aus welchem Rechtsgrund) der NYMEX gegenüber den Wertpapierinhabern im Zusammenhang mit dem Basiswert.

#### **a) Einheit je Vertrag**

1.000 Barrels (U.S.) = 42.000 Gallonen (U.S.) = 158.987 Liter

#### **b) Notierung**

Die Notierung erfolgt in US Dollars und Cents pro Barrel.

Weitere Informationen, wie zum Beispiel Laufzeit, Handel, letzter Handelstag, Preisfestsetzung und Preisveränderungen, können im Internet auf der Webseite der NYMEX ([www.cmegroup.com](http://www.cmegroup.com)), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: *Products & Trading* abgerufen werden.

Die auf den Internetseiten erhältlichen Informationen stellen Angaben Dritter dar. Die Emittentin hat diese Informationen keiner inhaltlichen Überprüfung unterzogen.

## **ENDGÜLTIGE WERTPAPIERBEDINGUNGEN**

Der für die Wertpapiere geltende Abschnitt A, §§ 1-3 (Produktspezifische Bedingungen) der Endgültigen Wertpapierbedingungen ist nachfolgend aufgeführt. Der für die Wertpapiere geltende Abschnitt B der Endgültigen Wertpapierbedingungen ist dem Abschnitt B, §§ 4-11 (Allgemeine Bedingungen) der Wertpapierbedingungen des Basisprospekts zu entnehmen.

Die Inhaber-Sammelurkunde verbrieft mehrere Wertpapiere ("**Serienemission**"), die sich lediglich in der wirtschaftlichen Ausgestaltung des in § 1 gewährten Wertpapierrechts unterscheiden. Die unterschiedlichen Ausstattungsmerkmale je Wertpapier sind in der Tabelle am Ende des Paragraphen § 1 dargestellt und der einzelnen Emission von Wertpapieren zugewiesen. Die nachfolgenden Wertpapierbedingungen finden daher in Bezug auf jedes Wertpapier einer Serienemission nach Maßgabe dieser Tabelle entsprechend Anwendung.

### **§ 1**

#### **Wertpapierrecht, Definitionen**

- (1) Die BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt am Main, ("**Emittentin**") gewährt jedem Inhaber ("**Wertpapierinhaber**") eines **Capped Bonus bzw. Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikats** ("**Wertpapier**" und zusammen die "**Wertpapiere**") bezogen auf den Basiswert ("**Basiswert**"), der in der am Ende dieses § 1 dargestellten Tabelle aufgeführt ist, das Recht ("**Wertpapierrecht**"), von der Emittentin nach Maßgabe dieser Wertpapierbedingungen Zahlung des in Absatz (2) bezeichneten Auszahlungsbetrages in EUR ("**Auszahlungswährung**") gemäß § 1 und § 5 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zu verlangen.
- (2) Der Auszahlungsbetrag ("**Auszahlungsbetrag**") ist der in der Referenzwährung bestimmte Maßgebliche Betrag ("**Maßgeblicher Betrag**"), der wie folgt ermittelt wird:

- (a) Wenn der Beobachtungskurs zu **keinem** Zeitpunkt innerhalb des Beobachtungszeitraumes die Barriere erreicht oder unterschritten hat, wird die Emittentin nach dem Bewertungstag einen Auszahlungsbetrag pro Wertpapier bestimmen, der ermittelt wird aus der Multiplikation (i) **entweder** des BonusLevels **oder, falls höher**, des Referenzpreises (ii) mit dem Bezugsverhältnis, **maximal** jedoch den Höchstbetrag, der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt:

$$\text{MIN}(\text{MAX}(\text{BonusLevel}; \text{Referenzpreis}); \text{Cap}) \times \text{B}$$

- (b) Wenn der Beobachtungskurs zu irgendeinem Zeitpunkt innerhalb des Beobachtungszeitraums die Barriere erreicht oder unterschritten hat, wird die Emittentin nach dem Bewertungstag einen Auszahlungsbetrag pro Wertpapier bestimmen, der ermittelt wird aus der Multiplikation des Referenzpreises mit dem Bezugsverhältnis, **maximal** jedoch den Höchstbetrag, der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt:

$$\text{MIN}(\text{Referenzpreis}; \text{Cap}) \times \text{B}$$

Es erfolgt eine Kaufmännische Rundung des so ermittelten Maßgeblichen Betrages auf die zweite Nachkommastelle.

Der Maßgebliche Betrag wird nach Maßgabe von § 1 Absatz (4) in die Auszahlungswährung umgerechnet, sofern die Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Ist der Maßgebliche Betrag Null (0), entspricht der Auszahlungsbetrag lediglich 1/10 Eurocent pro Wertpapier ("**Mindestbetrag**"). Bei der Zahlung des Mindestbetrages erfolgt eine Kaufmännische Rundung.

Die Emittentin wird spätestens am Fälligkeitstag den Auszahlungsbetrag an den Wertpapierinhaber zahlen.

(3) Im Sinne dieser Wertpapierbedingungen bedeutet:

**"Bankgeschäftstag"**: ist

- (a) jeder Tag (außer Samstag und Sonntag), an dem die Banken in Frankfurt am Main, in Wien und die CBF für den allgemeinen Geschäftsbetrieb geöffnet sind, und
- (b) im Zusammenhang mit Zahlungsvorgängen in EUR jeder Tag (außer Samstag und Sonntag), an dem das Trans-European Automated Real-Time Gross Settlement Express Transfer-Zahlungssystem (TARGET-System) geöffnet ist.

**"Barriere"**: ist die dem Wertpapier in der am Ende des §1 stehenden Tabelle zugewiesene Barriere.

**"Barrieren-Ereignis"**: ist das Ereignis, wenn der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Barriere erreicht oder unterschreitet.

**"Basiswert"**: ist der dem Wertpapier in der am Ende des §1 stehenden Tabelle zugewiesene Wert.

**"Beobachtungskurs"**: ist jeder innerhalb des Beobachtungszeitraums von der Referenzstelle als offizieller Kurs festgestellte und veröffentlichte Kurs des Basiswerts beginnend mit dem ersten offiziell festgestellten Kurs zum Beobachtungszeitraumbeginn.

**"Beobachtungszeitraum"**: ist der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle dem Wertpapier zugewiesene Zeitraum.

Der Beobachtungszeitraum beginnt zu dem Zeitpunkt, an dem der erste unter Beobachtungskurs definierte Kurs vorliegt, und endet mit der Feststellung des Referenzpreises (einschließlich).

Für den Beginn des Beobachtungszeitraums gilt § 3 entsprechend.

**"Bewertungstag"**: ist der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Bewertungstag.

Ist der Bewertungstag kein Handelstag, dann gilt der unmittelbar nachfolgende Handelstag als Bewertungstag. Wenn der Bewertungstag jedoch auf den letzten Handelstag für den Basiswert vor einem Verfalltermin für den Basiswert fällt und ist der Verfalltermin kein Handelstag, gilt die entsprechende Regelung der Referenzstelle (z.B. Vorverlegung bei Feiertagen).

Im Falle einer Marktstörung im Sinne des § 3 wird der Bewertungstag **maximal** um acht Handelstage verschoben.

**"Bezugsverhältnis" ("B")**: ist das dem Wertpapier in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene und als Dezimalzahl ausgedrückte Bezugsverhältnis.

**"BonusLevel"**: ist der dem Wertpapier in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene BonusLevel.

**"Cap"**: ist der dem Wertpapier in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Cap.

**"CBF"**: ist die Clearstream Banking AG Frankfurt (Mergenthalerallee 61, D-65760 Eschborn, Bundesrepublik Deutschland) oder ihre Nachfolgerin.

**"Fälligkeitstag"**: ist der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Fälligkeitstag (bzw. falls dieser Tag kein Bankgeschäftstag ist, der nächste unmittelbar nachfolgende Bankgeschäftstag); oder, falls ein späterer Tag, spätestens der vierte Bankgeschäftstag nach dem Bewertungstag.

**"Handelstag"**: ist jeder Tag, an dem im Hinblick auf den Basiswert

- (a) die Referenzstelle für den regulären Handel geöffnet ist, und
- (b) der Kurs des Basiswerts durch die in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle bestimmte Referenzstelle festgestellt wird.

**"Kaufmännische Rundung"**: ist der Vorgang des Abrundens oder Aufrundens. Wenn die Ziffer an der ersten wegfallenden Dezimalstelle eine 1, 2, 3 oder 4, ist, dann wird abgerundet. Ist die Ziffer an der ersten wegfallenden Dezimalstelle eine 5, 6, 7, 8 oder 9, dann wird aufgerundet.

**"Referenzpreis"**: ist der am Bewertungstag von der Referenzstelle als offizieller Schlusskurs (Settlement-Kurs) für den Basiswert **ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil"** gegenwärtig um 19:30 Uhr (London Ortszeit) festgestellte und auf der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle aufgeführten Internetseite veröffentlichte Kurs des Basiswerts.

**"Referenzpreis"**: ist der am Bewertungstag von der Referenzstelle als offizieller Schlusskurs (Settlement-Kurs) für den Basiswert **NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte** gegenwärtig um 14:30 Uhr (New York Ortszeit) festgestellte und auf der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle aufgeführten Internetseite veröffentlichte Kurs des Basiswerts.

Sollte der Referenzpreis am Bewertungstag nicht festgestellt werden und liegt keine Marktstörung gemäß § 3 vor, dann findet die für den Bewertungstag vorgesehene Regelung Anwendung.

**"Referenzstelle"**: ist die in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle dem Basiswert zugewiesene Stelle.

**"Referenzwährung"**: ist die dem Basiswert in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Währung.

- (4) Die nachfolgenden Bestimmungen zur Währungsumrechnung finden dann Anwendung, wenn die dem jeweiligen Basiswert zugeordnete Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Für die Umrechnung von der Referenzwährung in die Auszahlungswährung wird die Emittentin den *am International Interbank Spot Market* tatsächlich gehandelten Kurs zugrundelegen und die Umrechnung auf Grundlage dieses Wechselkurses vornehmen.

Produkt 2 (Capped Bonus bzw. Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikate):

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9TZU, DE000PB9TZU5 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	50,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 26.10.2017	26.10.2017 / 01.11.2017
PB9TZV, DE000PB9TZV3 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	50,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 26.10.2017	26.10.2017 / 01.11.2017
PB9TZW, DE000PB9TZW1 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COG7 Cmddy	Februar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 22.12.2016	22.12.2016 / 29.12.2016
PB9TZX, DE000PB9TZX9 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COG7 Cmddy	Februar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 22.12.2016	22.12.2016 / 29.12.2016
PB9TZY, DE000PB9TZY7 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COG7 Cmddy	Februar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 22.12.2016	22.12.2016 / 29.12.2016
PB9TZZ, DE000PB9TZZ4 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COG7 Cmddy	Februar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 22.12.2016	22.12.2016 / 29.12.2016
PB9TZ0, DE000PB9TZ00 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COG7 Cmddy	Februar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	46,00	70,00	70,00	20.10.2016 / 22.12.2016	22.12.2016 / 29.12.2016
PB9TZ1, DE000PB9TZ18 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COF7 Cmddy	Januar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 25.11.2016	25.11.2016 / 01.12.2016
PB9TZ2, DE000PB9TZ26 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COF7 Cmddy	Januar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 25.11.2016	25.11.2016 / 01.12.2016

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9TZ3, DE000PB9TZ34 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 25.11.2016	25.11.2016 / 01.12.2016
PB9TZ4, DE000PB9TZ42 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 25.11.2016	25.11.2016 / 01.12.2016
PB9TZ5, DE000PB9TZ59 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	34,00	42,00	42,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9TZ6, DE000PB9TZ67 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	34,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9TZ7, DE000PB9TZ75 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	38,00	46,00	46,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9TZ8, DE000PB9TZ83 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	38,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9TZ9, DE000PB9TZ91 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9T0A, DE000PB9T0A0 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9T0B, DE000PB9T0B8 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9T0C, DE000PB9T0C6 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	46,00	70,00	70,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* / Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T0D, DE000PB9T0D4 / 1.000.000	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil" / COM7 Cmddy	Juni 2017	Classic	USD	Intercontinental Exchange (ICE)	1	50,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 25.04.2017	25.04.2017 / 02.05.2017
PB9T0E, DE000PB9T0E2 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	48,00	48,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017
PB9T0F, DE000PB9T0F9 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017
PB9T0G, DE000PB9T0G7 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	46,00	46,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017
PB9T0H, DE000PB9T0H5 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017
PB9T0J, DE000PB9T0J1 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017
PB9T0K, DE000PB9T0K9 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmddy	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T0L, DE000PB9T0L7 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmnty	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017
PB9T0M, DE000PB9T0M5 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ7 Cmnty	Dezember 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	80,00	80,00	20.10.2016 / 15.11.2017	15.11.2017 / 21.11.2017
PB9T0N, DE000PB9T0N3 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	48,00	48,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018
PB9T0P, DE000PB9T0P8 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018
PB9T0Q, DE000PB9T0Q6 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	46,00	46,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018
PB9T0R, DE000PB9T0R4 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018
PB9T0S, DE000PB9T0S2 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T0T, DE000PB9T0T0 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018
PB9T0U, DE000PB9T0U8 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018
PB9T0V, DE000PB9T0V6 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLZ8 Cmnty	Dezember 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	80,00	80,00	20.10.2016 / 14.11.2018	14.11.2018 / 20.11.2018
PB9T0W, DE000PB9T0W4 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	40,00	54,00	54,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T0X, DE000PB9T0X2 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	40,00	68,00	68,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T0Y, DE000PB9T0Y0 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	52,00	52,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T0Z, DE000PB9T0Z7 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	66,00	66,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T00, DE000PB9T002 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	44,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T01, DE000PB9T010 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	45,00	54,00	54,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T02, DE000PB9T028 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	45,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T03, DE000PB9T036 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T04, DE000PB9T044 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLF7 Cmnty	Januar 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	48,00	58,00	58,00	20.10.2016 / 15.12.2016	15.12.2016 / 21.12.2016
PB9T05, DE000PB9T051 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	42,00	42,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017
PB9T06, DE000PB9T069 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T07, DE000PB9T077 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	46,00	46,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017
PB9T08, DE000PB9T085 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017
PB9T09, DE000PB9T093 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017
PB9T1A, DE000PB9T1A8 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017
PB9T1B, DE000PB9T1B6 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017
PB9T1C, DE000PB9T1C4 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	70,00	70,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017
PB9T1D, DE000PB9T1D2 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM7 Cmnty	Juni 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	50,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 17.05.2017	17.05.2017 / 23.05.2017

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T1F, DE000PB9T1F7 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	48,00	48,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018
PB9T1G, DE000PB9T1G5 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018
PB9T1H, DE000PB9T1H3 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	46,00	46,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018
PB9T1J, DE000PB9T1J9 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018
PB9T1K, DE000PB9T1K7 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018
PB9T1L, DE000PB9T1L5 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018
PB9T1M, DE000PB9T1M3 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T1N, DE000PB9T1N1 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLM8 Cmnty	Juni 2018	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	80,00	80,00	20.10.2016 / 17.05.2018	17.05.2018 / 23.05.2018
PB9T1P, DE000PB9T1P6 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLH7 Cmnty	März 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	46,00	46,00	20.10.2016 / 15.02.2017	15.02.2017 / 21.02.2017
PB9T1Q, DE000PB9T1Q4 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLH7 Cmnty	März 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 15.02.2017	15.02.2017 / 21.02.2017
PB9T1R, DE000PB9T1R2 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLH7 Cmnty	März 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 15.02.2017	15.02.2017 / 21.02.2017
PB9T1S, DE000PB9T1S0 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLH7 Cmnty	März 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 15.02.2017	15.02.2017 / 21.02.2017
PB9T1T, DE000PB9T1T8 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLH7 Cmnty	März 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 15.02.2017	15.02.2017 / 21.02.2017
PB9T1U, DE000PB9T1U6 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	42,00	42,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwahrung*	Referenzstelle*	Bezugsverhaltnis*	Barriere* in Referenzwahrung	BonusLevel* in Referenzwahrung	Cap* in Referenzwahrung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Falligkeitstag*
PB9T1V, DE000PB9T1V4 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	34,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017
PB9T1W, DE000PB9T1W2 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	46,00	46,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017
PB9T1X, DE000PB9T1X0 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	38,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017
PB9T1Y, DE000PB9T1Y8 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	55,00	55,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017
PB9T1Z, DE000PB9T1Z5 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	42,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017
PB9T10, DE000PB9T101 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	60,00	60,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017
PB9T11, DE000PB9T119 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmnty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	46,00	80,00	80,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017

WKN und ISIN der Wertpapiere / Volumen	Basiswert* (Futureskontrakt)/ Bloomberg-Code*/ Monat:		Typ*	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Barriere* in Referenzwährung	BonusLevel* in Referenzwährung	Cap* in Referenzwährung	Beobachtungszeitraum* Beginn / Ende	Bewertungstag* / Fälligkeitstag*
PB9T12, DE000PB9T127 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmdty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	50,00	65,00	65,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017
PB9T13, DE000PB9T135 / 1.000.000	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte / CLU7 Cmdty	September 2017	Classic	USD	New York Mercantile Exchange (NYMEX)	1	50,00	75,00	75,00	20.10.2016 / 17.08.2017	17.08.2017 / 23.08.2017

\* Zur Klarstellung gelten alle Angaben vorbehaltlich der Bestimmungen zu Anpassungen bzw. der sonstigen Bestimmungen der Wertpapierbedingungen

Bei den verwendeten Abkürzungen für die jeweilige Währung handelt es sich (mit Ausnahme der Abkürzung "GBp", die für Britische Pence Sterling steht und wobei GBp 100 einem Britischen Pfund Sterling ("GBP" 1,00) entsprechen) um die offiziell verwendeten ISO-Währungskürzel. ISO = International Organization for Standardization; Währungskürzel zur Zeit auch auf der Webseite: <http://publications.europa.eu/code/de/de-5000700.htm>

## § 2

### Anpassungen, außerordentliche Kündigung

(1) Wird der Kurs für den Basiswert nicht mehr von der Referenzstelle, sondern von einer anderen Person, Gesellschaft oder Institution, die die Emittentin für geeignet hält ("**Nachfolge-Referenzstelle**") berechnet und veröffentlicht, so wird der maßgebliche Kurs gegebenenfalls auf der Grundlage des von der Nachfolge-Referenzstelle berechneten und veröffentlichten Kurses berechnet. Jede in diesen Wertpapierbedingungen enthaltene Bezugnahme auf die Referenzstelle gilt, sofern es der Zusammenhang erlaubt, als Bezugnahme auf die Nachfolge-Referenzstelle. Eine Nachfolge-Referenzstelle im Hinblick auf den Basiswert wird unverzüglich gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt gemacht.

(2) Wenn:

- (a) die Notierung des Basiswertes bzw. der Handel in dem Basiswert ersatzlos aufgehoben wird,
- (b) die Formel und Art und Weise der bisherigen Berechnung bzw. wenn die Handelsbedingungen oder Kontraktsspezifikationen des Basiswertes durch die Referenzstelle so geändert werden, dass der Basiswert nach Feststellung der Emittentin nicht mehr mit dem bisherigen Basiswert vergleichbar ist,
- (c) der Basiswert von der Referenzstelle durch einen Wert ersetzt wird, der nach Feststellung der Emittentin im Hinblick auf Berechnungsmethode, Handelsbedingungen oder Kontraktsspezifikationen nicht mehr mit dem bisherigen Basiswert vergleichbar ist, oder
- (d) die Referenzstelle nicht in der Lage ist, die Berechnung des Basiswertes vorzunehmen, ausgenommen aus Gründen, die zugleich eine Marktstörung gemäß § 3 darstellen,
- (e) zum Zeitpunkt eines Roll Over, bei dem der Basiswert durch einen anderen Futureskontrakt ersetzt wird, (sofern ein solcher während der Laufzeit der Wertpapiere vorgesehen ist) nach Auffassung der Berechnungsstelle kein Basiswert existiert, der im Hinblick auf seine maßgeblichen Kontraktsspezifikationen mit dem zu ersetzenden Basiswert übereinstimmt, dessen Verfalltermin jedoch später in der Zukunft liegt,

wird die Emittentin, sofern die Wertpapiere nicht nach Absatz (3) gekündigt wurden, den betreffenden Basiswert durch einen Nachfolge-Basiswert, der nach Auffassung der Emittentin ähnliche Kontraktsspezifikationen wie der betreffende Basiswert aufweist, ersetzen ("**Nachfolge-Basiswert**") und bzw. oder die Wertpapierbedingungen in einer Weise anpassen, dass die Wertpapierinhaber wirtschaftlich soweit wie möglich so gestellt werden, wie sie vor Durchführung der Maßnahme nach diesem Absatz (2) standen. Jede in diesen Wertpapierbedingungen enthaltene Bezugnahme auf den Basiswert gilt im Fall der Ersetzung des betreffenden Basiswertes, sofern es der Zusammenhang erlaubt, als Bezugnahme auf den Nachfolge-Basiswert. Eine vorgenommene Ersetzung bzw. Anpassung wird unverzüglich gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt gemacht.

(3) Die Emittentin ist berechtigt aber nicht verpflichtet, die Wertpapiere in den in Absatz (2) genannten Fällen außerordentlich durch Bekanntmachung gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zu kündigen. Die Emittentin ist ebenfalls zur außerordentlichen Kündigung der Wertpapiere berechtigt, wenn die Verwendung des Basiswerts oder eines in dem Basiswert enthaltenen Bestandteils, auf den sich die Wertpapiere beziehen, rechtswidrig ist. Im Falle einer Kündigung zahlt die Emittentin anstatt der unter den Wertpapieren ansonsten zu leistenden Zahlungen an jeden Wertpapierinhaber einen Betrag je Wertpapier ("**Kündigungsbetrag**"), der von der Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) als angemessener Marktpreis des Wertpapiers unmittelbar vor dem zur Kündigung berechtigenden Ereignis festgelegt wird.

Die Emittentin wird den Kündigungsbetrag innerhalb von vier Bankgeschäftstagen nach dem Tag der Bekanntmachung gemäß § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) an die CBF oder ihrer Nachfolgerin zur Weiterleitung an die Wertpapierinhaber überweisen. Die Emittentin wird den Kündigungsbetrag gemäß § 5 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zahlen.

(4) Berechnungen, Entscheidungen und Feststellungen nach den vorstehenden Absätzen werden durch die Berechnungsstelle (§ 8 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen)) im Namen der Emittentin vorgenommen und sind für alle Beteiligten bindend, sofern nicht ein offensichtlicher Fehler vorliegt. Sämtliche Anpassungen sowie der Zeitpunkt ihres Inkrafttretens werden unverzüglich nach § 9 in Abschnitt B der Wertpapierbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt gemacht.

### § 3

#### Marktstörungen

- (1)
- (a) In Abweichung von Absatz (1)(b), wenn nach Auffassung der Emittentin zum Zeitpunkt der Feststellung des maßgeblichen Kurses eine Marktstörung, wie in Absatz (2) definiert, vorliegt, wird der betroffene Tag auf den unmittelbar nachfolgenden Handelstag, an dem keine Marktstörung mehr vorliegt, verschoben. Bei einer Verschiebung des Bewertungstages wird der Fälligkeitstag entsprechend angepasst.
  - (b) Wenn während des Beobachtungszeitraums eine Marktstörung vorliegt, kann die Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) während der Dauer dieser Marktstörung entweder die Feststellung des Beobachtungskurses aussetzen, oder anstelle des Beobachtungskurses einen von ihr auf Basis der dann geltenden Marktusancen und unter Berücksichtigung der dann herrschenden Marktgegebenheiten zu bestimmenden Ersatz-Kurs des Basiswertes zur Feststellung eines Barrieren-Ereignisses heranziehen.
- (2) Eine "**Marktstörung**" bedeutet:
- (a) die Suspendierung oder wesentliche Einschränkung des Handels bzw. der Preisfeststellung/ Preisfestlegung bezogen auf den Futureskontrakt an der Referenzstelle oder
  - (b) die Einschränkung des Handels aufgrund von Preisbewegungen, welche die von der Referenzstelle vorgegebenen Grenzen überschreiten, oder
  - (c) die wesentliche Veränderung in der Methode der Preisfeststellung bzw. in den Handelsbedingungen oder Kontraktspezifikationen bezogen auf den Futureskontrakt an der Referenzstelle.
- (3) Wenn der Bewertungstag um mehr als die in der Definition von Bewertungstag gemäß § 1 genannte Anzahl von Handelstagen nach Ablauf des ursprünglichen Tages verschoben worden ist und auch an diesem Tag die Marktstörung fortbesteht, dann gilt dieser Tag als Bewertungstag. Der für die Ermittlung des maßgeblichen Kurses verwendete Kurs entspricht dann dem von der Emittentin bestimmten Kurs, durch Zugrundelegung der Berechnungsweise und -methode des Futureskontraktes, die unmittelbar vor Eintritt der Marktstörung galt, wobei der Kurs des Futureskontraktes von der Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) zu bestimmen ist.

## Weitere Informationen

### **Börsennotierung und Zulassung zum Handel**

Die Beantragung der Einbeziehung der Wertpapiere in den Freiverkehr der Frankfurter Börse und der Börse Stuttgart ist beabsichtigt. Die Einbeziehung der Wertpapiere in den Handel ist für den 20. Oktober 2016 geplant.

### **Angebotskonditionen:**

#### **Angebotsfrist**

Vom 20. Oktober 2016 bis zum Ablauf der Gültigkeit des Prospekts

#### **Vertriebsstellen**

Banken und Sparkassen

#### **Berechnungsstelle**

BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C., Paris, Frankreich

#### **Emissionswährung**

EUR

#### **Emissionstermin**

24. Oktober 2016

#### **Valutatag**

24. Oktober 2016

### **Anfänglicher Ausgabepreis und Volumen je Serie**

Der anfängliche Ausgabepreis je Wertpapier sowie das Volumen der einzelnen Serien von Wertpapieren ist nachfolgender Tabelle zu entnehmen. Danach wird der Verkaufspreis von der BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C. fortlaufend festgesetzt.

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PB9TZU5	47,98	1.000.000
DE000PB9TZV3	51,22	1.000.000
DE000PB9TZW1	48,30	1.000.000
DE000PB9TZX9	56,12	1.000.000
DE000PB9TZY7	63,93	1.000.000
DE000PB9TZZ4	50,51	1.000.000
DE000PB9TZ00	56,80	1.000.000
DE000PB9TZ18	49,21	1.000.000
DE000PB9TZ26	57,68	1.000.000
DE000PB9TZ34	66,14	1.000.000
DE000PB9TZ42	51,79	1.000.000
DE000PB9TZ59	37,01	1.000.000
DE000PB9TZ67	47,41	1.000.000
DE000PB9TZ75	39,89	1.000.000
DE000PB9TZ83	50,11	1.000.000
DE000PB9TZ91	45,71	1.000.000
DE000PB9T0A0	58,10	1.000.000
DE000PB9T0B8	47,83	1.000.000
DE000PB9T0C6	52,73	1.000.000
DE000PB9T0D4	49,02	1.000.000
DE000PB9T0E2	40,13	1.000.000
DE000PB9T0F9	52,10	1.000.000
DE000PB9T0G7	38,40	1.000.000
DE000PB9T0H5	47,37	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PB9T0Z7	55,98	1.000.000
DE000PB9T002	50,46	1.000.000
DE000PB9T010	46,21	1.000.000
DE000PB9T028	49,88	1.000.000
DE000PB9T036	49,26	1.000.000
DE000PB9T044	47,23	1.000.000
DE000PB9T051	36,66	1.000.000
DE000PB9T069	46,66	1.000.000
DE000PB9T077	39,42	1.000.000
DE000PB9T085	49,09	1.000.000
DE000PB9T093	44,88	1.000.000
DE000PB9T1A8	56,21	1.000.000
DE000PB9T1B6	46,75	1.000.000
DE000PB9T1C4	51,02	1.000.000
DE000PB9T1D2	47,63	1.000.000
DE000PB9T1F7	39,31	1.000.000
DE000PB9T1G5	50,80	1.000.000
DE000PB9T1H3	37,67	1.000.000
DE000PB9T1J9	46,35	1.000.000
DE000PB9T1K7	42,82	1.000.000
DE000PB9T1L5	52,93	1.000.000
DE000PB9T1M3	44,90	1.000.000
DE000PB9T1N1	52,72	1.000.000
DE000PB9T1P6	40,40	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PB9T0J1	43,63	1.000.000
DE000PB9T0K9	54,06	1.000.000
DE000PB9T0L7	45,65	1.000.000
DE000PB9T0M5	53,55	1.000.000
DE000PB9T0N3	38,64	1.000.000
DE000PB9T0P8	49,80	1.000.000
DE000PB9T0Q6	37,06	1.000.000
DE000PB9T0R4	45,55	1.000.000
DE000PB9T0S2	42,14	1.000.000
DE000PB9T0T0	52,06	1.000.000
DE000PB9T0U8	44,26	1.000.000
DE000PB9T0V6	52,05	1.000.000
DE000PB9T0W4	47,58	1.000.000
DE000PB9T0X2	58,82	1.000.000
DE000PB9T0Y0	45,56	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PB9T1Q4	51,05	1.000.000
DE000PB9T1R2	46,18	1.000.000
DE000PB9T1S0	58,89	1.000.000
DE000PB9T1T8	47,77	1.000.000
DE000PB9T1U6	36,16	1.000.000
DE000PB9T1V4	45,72	1.000.000
DE000PB9T1W2	38,82	1.000.000
DE000PB9T1X0	48,04	1.000.000
DE000PB9T1Y8	44,13	1.000.000
DE000PB9T1Z5	54,85	1.000.000
DE000PB9T101	46,09	1.000.000
DE000PB9T119	54,10	1.000.000
DE000PB9T127	47,24	1.000.000
DE000PB9T135	49,78	1.000.000

**Mitgliedstaat(en) für die die  
Verwendung des Prospekts durch  
den/die zugelassenen Anbieter  
gestattet ist**

Bundesrepublik Deutschland und Republik Österreich

**Angabe der Tranche, die für bestimmte  
Märkten vorbehalten ist, wenn die  
Wertpapiere gleichzeitig an den  
Märkten zweier oder mehrerer Staaten  
angeboten werden**

Entfällt

**Details (Namen und Adressen) zu  
Platzeur(en)**

Entfällt

## Emissionsspezifische Zusammenfassung

Zusammenfassungen bestehen aus geforderten Angaben, die als "Punkte" bezeichnet werden. Diese Punkte werden nummeriert und den Abschnitten A bis E zugeordnet (A.1 - E.7).

Diese Zusammenfassung enthält alle Punkte, die für eine Zusammenfassung hinsichtlich dieser Art von Wertpapieren und dieser Art von Emittentin vorgeschrieben sind. Da einige Punkte nicht verpflichtend anzugeben sind, kann sich eine lückenhafte Aufzählungsreihenfolge ergeben.

Auch wenn aufgrund der Art der Wertpapiere und des Emittenten ein bestimmter Punkt als Bestandteil der Zusammenfassung vorgeschrieben ist, kann es vorkommen, dass für den betreffenden Punkt keine relevanten Informationen vorliegen. In diesem Fall enthält die Zusammenfassung eine kurze Beschreibung des Punktes mit dem Vermerk "entfällt".

### Abschnitt A - Einleitung und Warnhinweise

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
A.1	Warnhinweise	<p>Diese Zusammenfassung soll als Einführung zum Basisprospekt verstanden werden.</p> <p>Der Anleger sollte jede Entscheidung zur Anlage in die betreffenden Wertpapiere auf die Prüfung des gesamten Basisprospekts stützen.</p> <p>Für den Fall, dass vor einem Gericht Ansprüche auf Grund der in dem Basisprospekt enthaltenen Informationen geltend gemacht werden, könnte der als Kläger auftretende Anleger in Anwendung der einzelstaatlichen Rechtsvorschriften der Staaten des Europäischen Wirtschaftsraums die Kosten für die Übersetzung des Basisprospekts vor Prozessbeginn zu tragen haben.</p> <p>Diejenigen Personen, die die Verantwortung für die Zusammenfassung einschließlich etwaiger Übersetzungen hiervon übernommen haben oder von denen der Erlass ausgeht, können haftbar gemacht werden, jedoch nur für den Fall, dass die Zusammenfassung irreführend, unrichtig oder widersprüchlich ist, wenn sie zusammen mit den anderen Teilen des Basisprospekts gelesen wird, oder sie, wenn sie zusammen mit den anderen Teilen des Basisprospekts gelesen wird, nicht alle erforderlichen Schlüsselinformationen vermittelt.</p>
A.2	Zustimmung zur Verwendung des Prospekts	<p>Jeder Finanzintermediär, der die Wertpapiere nachfolgend weiter verkauft oder endgültig platziert, ist berechtigt, den Prospekt während der Dauer seiner Gültigkeit gemäß § 9 des Wertpapierprospektgesetzes, welches die Richtlinie 2003/71/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. November 2003 (geändert durch Richtlinie 2010/73/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010) umsetzt, zu verwenden. Die Emittentin stimmt dem späteren Weiterverkauf oder der endgültigen Platzierung der Wertpapiere durch sämtliche Finanzintermediäre in Deutschland und/oder Österreich und/oder Luxemburg, deren zuständiger Behörde eine Notifizierung des Prospektes übermittelt wurde, zu. Ein solcher späterer Weiterverkauf oder eine solche endgültige Platzierung setzt jeweils voraus, dass der Prospekt in Übereinstimmung mit § 9 des Wertpapierprospektgesetzes noch gültig ist.</p> <p>Der Prospekt darf potenziellen Investoren nur zusammen mit sämtlichen bis zur Übergabe veröffentlichten Nachträgen übergeben werden. Jeder Nachtrag zum Prospekt kann in elektronischer Form auf der folgenden Internetseite der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH (<a href="http://www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte">www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte</a>) abgerufen werden.</p> <p>Bei der Nutzung des Prospektes hat jeder Finanzintermediär sicherzustellen, dass er alle anwendbaren, in den jeweiligen Jurisdiktionen geltenden Gesetze und Rechtsvorschriften beachtet.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		Jeder den Prospekt verwendende Finanzintermediär hat auf seiner Webseite anzugeben, dass er den Prospekt mit Zustimmung und gemäß den Bedingungen verwendet, an die die Zustimmung gebunden ist.

#### Abschnitt B - Emittent

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
B.1	Juristischer und kommerzieller Name der Emittentin	Die Emittentin führt die Firma BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH. Der kommerzielle Name entspricht der Firma.
B.2	Sitz, Rechtsform, Rechtsordnung	Sitz der Emittentin ist Frankfurt am Main. Die Geschäftsadresse lautet: Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main, Bundesrepublik Deutschland.  Die BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH ist eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung gemäß deutschem Recht.
B.4b	Trends, die sich auf die Emittentin und die Branchen, in denen sie tätig ist, auswirken	Die Entwicklung im laufenden Geschäftsjahr wird in hohem Maße von der allgemeinen Marktentwicklung abhängig sein. Sollten die Aktienmärkte stabil bleiben oder steigen, werden für das laufende Geschäftsjahr eine stabile bzw. gesteigerte Emissionstätigkeit und ein gleich bleibender Marktanteil bzw. ein Ausbau des Marktanteils der Gesellschaft erwartet.  Bei einer starken Verschlechterung der makroökonomischen Lage in der Eurozone oder fallenden Aktienmärkten dürfte sich ein Rückgang der Umsätze und der Emissionsstätigkeit ergeben. Eine unerwartet stärkere Regulierung würde sich ebenfalls negativ auf die Geschäftsentwicklung der Emittentin auswirken.
B.5	Konzernstruktur	Alleinige Gesellschafterin der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH ist die BNP PARIBAS S.A., eine börsennotierte Aktiengesellschaft nach französischem Recht. Die BNP PARIBAS S.A. ist, nach Selbsteinschätzung, eine der führenden Banken Frankreichs und unterhält Zweigstellen und Tochtergesellschaften in allen wichtigen Märkten. Nach gegenwärtigem Kenntnisstand der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH gibt es keine Vereinbarungen oder Pläne über eine Änderung der Gesellschafterstruktur.
B.9	Gewinnprognosen oder -schätzungen	Entfällt.  Die Emittentin gibt derzeit keine Gewinnprognosen oder -schätzungen ab.
B.10	Beschränkungen im Bestätigungsvermerk	Entfällt.  Der Jahresabschluss der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH für das am 31. Dezember 2014 endende Geschäftsjahr ist von MAZARS GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Theodor-Stern-Kai 1, 60596 Frankfurt am Main, geprüft und mit einem uneingeschränkten Bestätigungsvermerk versehen worden.  Der Jahresabschluss der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH für das am 31. Dezember 2015 endende Geschäftsjahr ist von MAZARS GmbH & Co. KG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Theodor-Stern-Kai 1, 60596 Frankfurt am Main, geprüft und mit einem uneingeschränkten Bestätigungsvermerk versehen worden.

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben																														
B.12	Ausgewählte wesentliche historische Finanzinformationen	<p>Die folgende Tabelle zeigt ausgewählte Finanzinformationen der Emittentin, die den geprüften Jahresabschlüssen der Emittentin zum 31. Dezember 2014 und zum 31. Dezember 2015 entnommen wurden. Die vorgenannten Abschlüsse wurden nach den Vorschriften des Handelsgesetzbuches ("HGB") und den ergänzenden Vorschriften des GmbH-Gesetzes ("GmbHG") aufgestellt.</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Finanzinformation</th> <th>Jahresabschluss 31. Dezember 2014 EUR</th> <th>Jahresabschluss 31. Dezember 2015 EUR</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td colspan="3"><b>Bilanz</b></td> </tr> <tr> <td colspan="3">I. Forderungen und sonstige Vermögensgegenstände</td> </tr> <tr> <td>1. Forderungen gegen verbundene Unternehmen</td> <td>352.063.566,33</td> <td>366.234.688,16</td> </tr> <tr> <td>2. Sonstige Vermögensgegenstände (Aktiva/Umlaufvermögen)</td> <td>2.635.825.587,32</td> <td>2.146.444.601,92</td> </tr> <tr> <td>Anleihen (Passiva/Verbindlichkeiten)</td> <td>2.320.670.660,58</td> <td>1.882.942.501,37</td> </tr> <tr> <td>Sonstige Verbindlichkeiten (Passiva/Verbindlichkeiten)</td> <td>667.197.740,67</td> <td>629.737.026,21</td> </tr> <tr> <td colspan="3"><b>Gewinn- und Verlustrechnung</b></td> </tr> <tr> <td>Sonstige betriebliche Erträge</td> <td>1.424.607,25</td> <td>1.355.546,91</td> </tr> <tr> <td>Sonstige betriebliche Aufwendungen</td> <td>-1.424.607,25</td> <td>-1.355.546,91</td> </tr> </tbody> </table> <p>Die Aussichten der Emittentin haben sich seit dem 31. Dezember 2015 nicht verschlechtert.</p> <p>Es sind keine wesentlichen Veränderungen in der Finanzlage oder der Handelsposition seit dem 31. Dezember 2015 eingetreten.</p>	Finanzinformation	Jahresabschluss 31. Dezember 2014 EUR	Jahresabschluss 31. Dezember 2015 EUR	<b>Bilanz</b>			I. Forderungen und sonstige Vermögensgegenstände			1. Forderungen gegen verbundene Unternehmen	352.063.566,33	366.234.688,16	2. Sonstige Vermögensgegenstände (Aktiva/Umlaufvermögen)	2.635.825.587,32	2.146.444.601,92	Anleihen (Passiva/Verbindlichkeiten)	2.320.670.660,58	1.882.942.501,37	Sonstige Verbindlichkeiten (Passiva/Verbindlichkeiten)	667.197.740,67	629.737.026,21	<b>Gewinn- und Verlustrechnung</b>			Sonstige betriebliche Erträge	1.424.607,25	1.355.546,91	Sonstige betriebliche Aufwendungen	-1.424.607,25	-1.355.546,91
Finanzinformation	Jahresabschluss 31. Dezember 2014 EUR	Jahresabschluss 31. Dezember 2015 EUR																														
<b>Bilanz</b>																																
I. Forderungen und sonstige Vermögensgegenstände																																
1. Forderungen gegen verbundene Unternehmen	352.063.566,33	366.234.688,16																														
2. Sonstige Vermögensgegenstände (Aktiva/Umlaufvermögen)	2.635.825.587,32	2.146.444.601,92																														
Anleihen (Passiva/Verbindlichkeiten)	2.320.670.660,58	1.882.942.501,37																														
Sonstige Verbindlichkeiten (Passiva/Verbindlichkeiten)	667.197.740,67	629.737.026,21																														
<b>Gewinn- und Verlustrechnung</b>																																
Sonstige betriebliche Erträge	1.424.607,25	1.355.546,91																														
Sonstige betriebliche Aufwendungen	-1.424.607,25	-1.355.546,91																														
B.13	Aktuelle Entwicklungen	<p>Entfällt.</p> <p>Es gibt keine Ereignisse aus der jüngsten Zeit der Geschäftstätigkeit der Emittentin, die für die Bewertung ihrer Zahlungsfähigkeit in hohem Maße relevant sind.</p>																														
B.14	Abhängigkeit der Emittentin von anderen Konzerngesellschaften	<p>Die Gesellschaftsstruktur der Emittentin in Bezug auf die BNP Paribas S.A. ist unter Punkt B.5 aufgeführt.</p> <p>Alleinige Gesellschafterin der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH ist die BNP PARIBAS S.A., eine börsennotierte Aktiengesellschaft nach französischem Recht.</p>																														
B.15	Geschäftstätigkeit, wichtigste Märkte, Haupttätigkeit	<p>Gegenstand der Gesellschaft sind gemäß § 2 des Gesellschaftsvertrages die Begebung, der Verkauf, der Erwerb und das Halten von Wertpapieren für eigene Rechnung, der Erwerb sowie die Veräußerung von Immobilien und Waren jeglicher Art für eigene Rechnung sowie alle Geschäfte, die damit unmittelbar oder mittelbar zusammenhängen mit Ausnahme von Geschäften, die eine Erlaubnis nach dem Kreditwesengesetz oder der Gewerbeordnung erfordern. Die Gesellschaft ist zu allen Rechtsgeschäften und sonstigen Handlungen berechtigt, die ihr zur Erreichung des Gesellschaftszwecks notwendig oder nützlich erscheinen. Insbesondere darf sie Zweigniederlassungen errichten, sich an Unternehmen gleicher oder ähnlicher Art beteiligen und Organschafts- und sonstige Unternehmensverträge abschließen.</p>																														

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		Haupttätigkeitsbereiche der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH sind die Begebung und der Verkauf von Wertpapieren für eigene Rechnung. Die von der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH begebenen und von der BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C. angebotenen Wertpapiere werden zurzeit auf dem deutschen und dem österreichischen Markt und auch auf dem luxemburgischen Markt angeboten. Die von der Gesellschaft begebenen Wertpapiere können auch von anderen Unternehmen der BNP Paribas Gruppe übernommen und angeboten werden.
B.16	Wesentliche Beteiligungen und Beherrschungen	<p>Zwischen der BNP PARIBAS S.A und der Emittentin besteht ein Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag. Demnach ist die Emittentin verpflichtet, den gesamten nach den maßgeblichen handelsrechtlichen Vorschriften ermittelten Gewinn an die BNP PARIBAS S.A. abzuführen. Zugleich hat die BNP PARIBAS S.A jeden während der Vertragsdauer bei der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH entstehenden Verlust auszugleichen, soweit dieser nicht durch die Verwendung von Gewinnrücklagen gedeckt werden kann. Auf der Grundlage des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrages kann die BNP PARIBAS S.A der Emittentin alle ihr zweckdienlich erscheinenden (<u>gegebenenfalls auch für die Emittentin nachteiligen</u>) Weisungen erteilen. Darüber hinaus ist die BNP PARIBAS S.A berechtigt, jederzeit die Bücher und Schriften der Emittentin einzusehen und Auskünfte insbesondere über die rechtlichen, geschäftlichen und verwaltungsmäßigen Angelegenheiten der Gesellschaft zu verlangen.</p> <p>Der Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag kann mit einjähriger Kündigungsfrist zum Ende des Kalenderjahres ordentlich gekündigt werden. Der Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag ist bis zum gegenwärtigen Zeitpunkt nicht gekündigt. Die Beendigung des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrages wird von der Emittentin unverzüglich veröffentlicht und durch Mitteilung der entsprechenden Bekanntmachung an die Clearstream Banking AG Frankfurt zur Weiterleitung an die Wertpapierinhaber bekannt gemacht.</p>

### Abschnitt C - Wertpapiere

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
C.1	Art und Gattung der angebotenen Wertpapiere, ISIN	<p>Die Wertpapiere werden in Form von Inhaberschuldverschreibungen im Sinne von § 793 BGB begeben und begründen unmittelbare und nicht nachrangige Verbindlichkeiten der Emittentin, für die die Emittentin keine Sicherheiten bestellt hat.</p> <p>Die ISIN jeder einzelnen Serie von Wertpapieren lautet: DE000PB9TZU5, DE000PB9TZV3, DE000PB9TZW1, DE000PB9TZX9, DE000PB9TZY7, DE000PB9TZZ4, DE000PB9TZ00, DE000PB9TZ18, DE000PB9TZ26, DE000PB9TZ34, DE000PB9TZ42, DE000PB9TZ59, DE000PB9TZ67, DE000PB9TZ75, DE000PB9TZ83, DE000PB9TZ91, DE000PB9T0A0, DE000PB9T0B8, DE000PB9T0C6, DE000PB9T0D4, DE000PB9T0E2, DE000PB9T0F9, DE000PB9T0G7, DE000PB9T0H5, DE000PB9T0J1, DE000PB9T0K9, DE000PB9T0L7, DE000PB9T0M5, DE000PB9T0N3, DE000PB9T0P8, DE000PB9T0Q6, DE000PB9T0R4, DE000PB9T0S2, DE000PB9T0T0, DE000PB9T0U8, DE000PB9T0V6, DE000PB9T0W4, DE000PB9T0X2, DE000PB9T0Y0, DE000PB9T0Z7, DE000PB9T002, DE000PB9T010, DE000PB9T028, DE000PB9T036, DE000PB9T044, DE000PB9T051, DE000PB9T069, DE000PB9T077, DE000PB9T085, DE000PB9T093, DE000PB9T1A8, DE000PB9T1B6, DE000PB9T1C4, DE000PB9T1D2, DE000PB9T1F7, DE000PB9T1G5, DE000PB9T1H3, DE000PB9T1J9, DE000PB9T1K7, DE000PB9T1L5, DE000PB9T1M3, DE000PB9T1N1, DE000PB9T1P6, DE000PB9T1Q4, DE000PB9T1R2, DE000PB9T1S0, DE000PB9T1T8, DE000PB9T1U6, DE000PB9T1V4, DE000PB9T1W2, DE000PB9T1X0, DE000PB9T1Y8, DE000PB9T1Z5, DE000PB9T101, DE000PB9T119, DE000PB9T127, DE000PB9T135.</p> <p>Die unter diesem Prospekt angebotenen Wertpapiere sind Wertpapiere, welche nicht verzinst werden. Die Emittentin ist verpflichtet, nach Maßgabe der Wertpapierbedingungen in Abhängigkeit von der Entwicklung des jeweils zugrundeliegenden Basiswertes dem Wertpapierinhaber am Fälligkeitstag einen Auszahlungsbetrag zu zahlen.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
C.2	Währung	Die Wertpapiere werden in: EUR begeben und ausgezahlt.
C.5	Beschränkungen für die freie Übertragbarkeit	Entfällt. Die Wertpapiere sind frei übertragbar und unterliegen keinen Beschränkungen.
C.8	Mit den Wertpapieren verbundene Rechte, einschließlich der Rangordnung und der Beschränkung dieser Rechte	<p><u>Mit den Wertpapieren verbundene Rechte</u></p> <p>Die Wertpapiere werden nicht verzinst.</p> <p>Die Wertpapiere gelten ohne weitere Voraussetzung am Bewertungstag als ausgeübt.</p> <p><u>Rückzahlung</u></p> <p>Durch die Wertpapiere erhält der Wertpapierinhaber am Fälligkeitstag einen Anspruch auf Erhalt eines Auszahlungsbetrages, wie unter C.18 beschrieben.</p> <p><u>Vorzeitige Rückzahlung</u></p> <p>Die Emittentin kann berechtigt sein, bei Vorliegen eines Anpassungsereignisses in Bezug auf den Basiswert, das Wertpapierrecht in Übereinstimmung mit den Wertpapierbedingungen anzupassen oder die Wertpapiere außerordentlich zu kündigen. Im Falle einer solchen außerordentlichen Kündigung zahlt die Emittentin den Kündigungsbetrag innerhalb von vier Bankgeschäftstagen nach der Bekanntmachung der Kündigung. In diesem Fall kann der Kündigungsbetrag (wie nachstehend unter D.6 definiert) unter Umständen auch erheblich unter dem für das Wertpapier gezahlten Kaufpreis liegen und bis auf Null (0) sinken (Totalverlust des eingesetzten Kapitals).</p> <p><u>Rangordnung</u></p> <p>Die Wertpapiere begründen unmittelbare und nicht nachrangige Verbindlichkeiten der Emittentin, für die die Emittentin keine Sicherheiten bestellt hat. Die Wertpapiere stehen untereinander und mit allen sonstigen gegenwärtigen und künftigen unbesicherten und nicht nachrangigen Verbindlichkeiten der Emittentin im gleichen Rang, ausgenommen solche Verbindlichkeiten, denen aufgrund zwingender gesetzlicher Vorschriften Vorrang zukommt.</p> <p><u>Beschränkung der mit den Wertpapieren verbundenen Rechte</u></p> <p>Die Emittentin ist unter bestimmten Voraussetzungen zur Anpassung der Wertpapierbedingungen berechtigt.</p> <p>Darüber hinaus kann die Emittentin berechtigt sein, bei Vorliegen eines Anpassungsereignisses in Bezug auf den Basiswert, die Wertpapiere außerordentlich zu kündigen. Im Falle einer solchen außerordentlichen vorzeitigen Kündigung zahlt die Emittentin den Kündigungsbetrag innerhalb von vier Bankgeschäftstagen nach der Bekanntmachung der Kündigung. In diesem Fall kann der Kündigungsbetrag (wie nachstehend unter D.6 definiert) unter Umständen auch erheblich unter dem Nennwert bzw. dem für das Wertpapier gezahlten Kaufpreis liegen und bis auf Null (0) sinken (Totalverlust des eingesetzten Kapitals).</p>
C.11	Zulassung der Wertpapiere zum Handel an einem geregelten Markt oder anderen gleichwertigen Märkten	Entfällt. Die Wertpapiere werden nicht an einem regulierten Markt notiert. Die Beantragung der Einbeziehung der Wertpapiere in den Freiverkehr der Frankfurter Börse und der Börse Stuttgart ist beabsichtigt.

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
C.15	Beeinflussung des Anlagewertes durch den Wert des Basisinstruments	Mit den vorliegenden Wertpapieren kann der Anleger unter Umständen überproportional an der positiven Wertentwicklung des Basiswertes partizipieren. Der Anleger nimmt jedoch auch überproportional an der negativen Wertentwicklung des Basiswertes teil und trägt das Risiko eines wertlosen Verfalls der Wertpapiere.  Die Partizipation ist auf einen Höchstbetrag begrenzt.
C.16	Verfalltag oder Fälligkeitstermin der derivativen Wertpapiere	<u>Fälligkeitstag und Bewertungstag:</u>

ISIN	Bewertungstag	Fälligkeitstag	ISIN	Bewertungstag	Fälligkeitstag
DE000PB9TZU5	26.10.2017	01.11.2017	DE000PB9T0Z7	15.12.2016	21.12.2016
DE000PB9TZV3	26.10.2017	01.11.2017	DE000PB9T002	15.12.2016	21.12.2016
DE000PB9TZW1	22.12.2016	29.12.2016	DE000PB9T010	15.12.2016	21.12.2016
DE000PB9TZX9	22.12.2016	29.12.2016	DE000PB9T028	15.12.2016	21.12.2016
DE000PB9TZY7	22.12.2016	29.12.2016	DE000PB9T036	15.12.2016	21.12.2016
DE000PB9TZZ4	22.12.2016	29.12.2016	DE000PB9T044	15.12.2016	21.12.2016
DE000PB9TZ00	22.12.2016	29.12.2016	DE000PB9T051	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ18	25.11.2016	01.12.2016	DE000PB9T069	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ26	25.11.2016	01.12.2016	DE000PB9T077	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ34	25.11.2016	01.12.2016	DE000PB9T085	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ42	25.11.2016	01.12.2016	DE000PB9T093	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ59	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1A8	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ67	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1B6	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ75	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1C4	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ83	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1D2	17.05.2017	23.05.2017
DE000PB9TZ91	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1F7	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0A0	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1G5	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0B8	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1H3	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0C6	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1J9	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0D4	25.04.2017	02.05.2017	DE000PB9T1K7	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0E2	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1L5	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0F9	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1M3	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0G7	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1N1	17.05.2018	23.05.2018
DE000PB9T0H5	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1P6	15.02.2017	21.02.2017
DE000PB9T0J1	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1Q4	15.02.2017	21.02.2017
DE000PB9T0K9	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1R2	15.02.2017	21.02.2017
DE000PB9T0L7	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1S0	15.02.2017	21.02.2017
DE000PB9T0M5	15.11.2017	21.11.2017	DE000PB9T1T8	15.02.2017	21.02.2017
DE000PB9T0N3	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T1U6	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0P8	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T1V4	17.08.2017	23.08.2017

ISIN	Bewertungstag	Fälligkeitstag	ISIN	Bewertungstag	Fälligkeitstag
DE000PB9T0Q6	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T1W2	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0R4	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T1X0	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0S2	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T1Y8	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0T0	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T1Z5	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0U8	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T101	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0V6	14.11.2018	20.11.2018	DE000PB9T119	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0W4	15.12.2016	21.12.2016	DE000PB9T127	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0X2	15.12.2016	21.12.2016	DE000PB9T135	17.08.2017	23.08.2017
DE000PB9T0Y0	15.12.2016	21.12.2016			

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben									
C.17	Abrechnungsverfahren für die derivativen Wertpapiere	Sämtliche Beträge werden von der Emittentin über die Zahlstelle durch Überweisung an die CBF (Clearstream Banking AG Frankfurt oder ihre Nachfolgerin) zur Weiterleitung an die Wertpapierinhaber gezahlt bzw. veranlasst. Die Emittentin wird durch Leistung der Zahlung an die CBF oder zu deren Gunsten von ihrer Zahlungspflicht befreit.									
C.18	Ertragsmodalitäten bei derivativen Wertpapieren	<p>Die Zahlung des Auszahlungsbetrages in der Auszahlungswährung pro Wertpapier erfolgt spätestens am Fälligkeitstag an den Wertpapierinhaber.</p> <p>Der Auszahlungsbetrag errechnet sich bei Capped Bonus/Capped Bonus<sup>PRO</sup> Zertifikaten</p> <p>(a) wenn die Barriere nicht erreicht oder unterschritten wird, aus der Multiplikation (i) entweder des BonusLevels oder, falls höher, des Referenzpreises (ii) mit dem Bezugsverhältnis, maximal jedoch aus dem Höchstbetrag der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt;</p> <p>(b) wenn die Barriere erreicht oder unterschritten wird, aus der Multiplikation des Referenzpreises mit dem Bezugsverhältnis, maximal jedoch aus dem Höchstbetrag, der sich aus der Multiplikation des Caps mit dem Bezugsverhältnis ergibt.</p> <p>Ist der maßgebliche Betrag Null (0), entspricht der Auszahlungsbetrag lediglich 1/10 Eurocent pro Wertpapier (Mindestbetrag).</p>									
C.19	Ausübungspreis oder endgültiger Referenzpreis des Basiswertes	<p>Der endgültige Referenzpreis (welcher dem in der Verordnung genannten Ausübungspreis entspricht) eines jeden Wertpapierses ist der jeweils festgestellte Preis bzw. Kurs des Basiswerts am Bewertungstag. Die Wertpapiere gelten ohne weitere Voraussetzung am Bewertungstag als ausgeübt.</p> <p>Vorbehaltlich etwaiger Anpassungs- und Störungsregeln, ist der Referenzpreis der am Bewertungstag von der Referenzstelle als offizieller Schlusskurs (Settlement-Kurs) - wie in nachfolgender Tabelle aufgeführt - festgestellte und veröffentlichte Kurs des Basiswerts.</p> <table border="1" data-bbox="520 1729 1484 2011"> <thead> <tr> <th>Basiswert</th> <th>Referenzpreis</th> <th>Referenzstelle</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil"</td> <td>Schlusskurs (Settlement-Kurs) (Preisfeststellung gegenwärtig 19:30 Uhr (London Ortszeit))</td> <td>Intercontinental Exchange (ICE)</td> </tr> <tr> <td>NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte</td> <td>Schlusskurs (Settlement-Kurs) (Preisfeststellung gegenwärtig 14:30 Uhr (New York Ortszeit))</td> <td>New York Mercantile Exchange (NYMEX)</td> </tr> </tbody> </table>	Basiswert	Referenzpreis	Referenzstelle	ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil"	Schlusskurs (Settlement-Kurs) (Preisfeststellung gegenwärtig 19:30 Uhr (London Ortszeit))	Intercontinental Exchange (ICE)	NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte	Schlusskurs (Settlement-Kurs) (Preisfeststellung gegenwärtig 14:30 Uhr (New York Ortszeit))	New York Mercantile Exchange (NYMEX)
Basiswert	Referenzpreis	Referenzstelle									
ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil"	Schlusskurs (Settlement-Kurs) (Preisfeststellung gegenwärtig 19:30 Uhr (London Ortszeit))	Intercontinental Exchange (ICE)									
NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte	Schlusskurs (Settlement-Kurs) (Preisfeststellung gegenwärtig 14:30 Uhr (New York Ortszeit))	New York Mercantile Exchange (NYMEX)									

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
C.20	Art des Basiswertes/ Ort, an dem Informationen über den Basiswert erhältlich sind	Art des Basiswerts: Futureskontrakte.  Der Basiswert und die entsprechende Internetseite auf der Informationen über den Basiswert zum Emissionstermin jeder einzelnen Serie von Wertpapieren erhältlich sind:

Basiswert	Internetseite
ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte "Brent Crude Oil"	www.theice.com
NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte	www.cmegroup.com

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p style="text-align: center;"><b>ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte „Brent Crude Oil“</b></p> <p>Der Basiswert, der ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte „Brent Crude Oil“ (ICE Brent Crude Futures Contract), im Folgenden auch als "Kontrakt(e)" bezeichnet, ist ein an der Intercontinental Exchange, Inc. ("ICE"), London gehandelter Futureskontrakt bezogen auf Rohöl der Sorte Brent (Qualität gemäß dem Pipeline-Austritt in Sullom Voe).</p> <p>ICE Futureskontrakte für Rohöl der Sorte „Brent Crude Oil“ sind Verträge, die auf physischer Lieferung von Rohöl, mit der Möglichkeit zum Barausgleich basieren. Eine Beschreibung der Verträge ist auf der Webseite der ICE (www.theice.com), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: <i>Products</i>, zu finden.</p> <p>Es wird darauf hingewiesen, dass die ICE in keiner Weise in die Emission der Wertpapiere und/oder ihren Vertrieb involviert ist. Weder hat die ICE der Nutzung des Basiswertes für den Zweck dieses Wertpapiere noch seiner Bezugnahme in diesem Dokument zugestimmt, noch bestehen irgendwelche Pflichten (gleich aus welchem Rechtsgrund) der ICE gegenüber den Wertpapierinhabern im Zusammenhang mit dem Basiswert.</p> <p><b>a) Einheit je Vertrag</b> 1.000 Barrels (U.S.) = 42.000 Gallonen (U.S.) = 158.987 Liter</p> <p><b>b) Notierung</b> Die Notierung erfolgt in US Dollar und Cent pro Barrel.</p> <p>Weitere Informationen, wie zum Beispiel Laufzeit, Handel, letzter Handelstag, Preisfestsetzung und Preisveränderungen, können im Internet auf der Webseite der ICE (www.theice.com), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: <i>Products</i>, abgerufen werden.</p> <p style="text-align: center;"><b>NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakte</b></p> <p>Der Basiswert, der NYMEX West Texas Intermediate ("WTI") Light Sweet Crude Oil Futureskontrakt, im Folgenden auch als "Kontrakt(e)" bezeichnet, ist ein an der New York Mercantile Exchange, Inc. ("NYMEX") gehandelter Vertrag bezogen auf die zukünftige Lieferung von leichtem Qualitätsrohöl, das in Oklahoma oder Texas produziert wird.</p> <p>WTI Futureskontrakte sind Verträge auf die zukünftige Lieferung von "Light, sweet crude oil" ("leichtes Qualitätsrohöl"). Eine Beschreibung der Verträge ist auf der Webseite der NYMEX (www.cmegroup.com), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: <i>Products &amp; Trading</i>, zu finden.</p> <p>Es wird darauf hingewiesen, dass die NYMEX in keiner Weise in die Emission der Wertpapiere und/oder ihren Vertrieb involviert ist. Weder hat die NYMEX der Nutzung des Basiswertes für den Zweck dieser Wertpapiere noch seiner Bezugnahme in diesem Dokument zugestimmt, noch bestehen irgendwelche Pflichten (gleich aus welchem Rechtsgrund) der NYMEX gegenüber den Wertpapierinhabern im Zusammenhang mit dem Basiswert.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p><b>a) Einheit je Vertrag</b> 1.000 Barrels (U.S.) = 42.000 Gallonen (U.S.) = 158.987 Liter</p> <p><b>b) Notierung</b> Die Notierung erfolgt in US Dollars und Cents pro Barrel.</p> <p>Weitere Informationen, wie zum Beispiel Laufzeit, Handel, letzter Handelstag, Preisfestsetzung und Preisveränderungen, können im Internet auf der Webseite der NYMEX (<a href="http://www.cmegroup.com">www.cmegroup.com</a>), gegenwärtig unter dem Menüpunkt: <i>Products &amp; Trading</i> abgerufen werden.</p> <p>Die auf den Internetseiten erhältlichen Informationen stellen Angaben Dritter dar. Die Emittentin hat diese Informationen keiner inhaltlichen Überprüfung unterzogen.</p>

#### Abschnitt D - Risiken

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
D.2	Wesentliche Risiken in Bezug auf die Emittentin	<p>Bei den nachfolgenden Risikofaktoren handelt es sich um die wesentlichen Risikofaktoren, die der Emittentin eigen sind.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Jeder Anleger trägt das Risiko einer Insolvenz der Emittentin. Eine Insolvenz der Emittentin kann trotz des bestehenden Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrages mit BNP PARIBAS S.A. eintreten. Im Falle der Insolvenz kann der Insolvenzverwalter den bei der Emittentin entstandenen Jahresfehlbetrag gemäß § 302 Abs. 1 Aktiengesetz gegen BNP PARIBAS S.A. geltend machen. Dieser Anspruch beläuft sich auf den bis zur Eröffnung des Insolvenzverfahrens bei der Emittentin entstehenden Fehlbetrag.</li> <li>- Die Befriedigung des Anspruchs der Schuldverschreibungsinhaber gegen die Insolvenzmasse der Emittentin kann unter Umständen nur teilweise oder sogar gar nicht erfolgen.</li> <li>- Zwischen der BNP PARIBAS S.A. und der Emittentin besteht ein Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag. Auf der Grundlage des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrags kann die BNP PARIBAS S.A. der Emittentin alle ihr zweckdienlich erscheinenden Weisungen erteilen, darunter gegebenenfalls auch für die Emittentin nachteilige Weisungen.</li> </ul> <p>Es kann nicht ausgeschlossen werden, dass die BNP PARIBAS S.A. Weisungen an die Emittentin erteilt, die sich nachteilig auf die Vermögens-, Finanz-, und Ertragslage sowie die Liquidität der Emittentin auswirken können, und die damit die Fähigkeit der Emittentin, ihren Verpflichtungen unter den Wertpapieren nachzukommen, nachteilig beeinflussen können.</p> <p>Eine Erteilung nachteiliger Weisungen und die damit verbundenen vorstehenden Risiken sind nicht zuletzt abhängig von der Vermögens-, Finanz-, und Ertragslage sowie der Liquidität der BNP PARIBAS S.A. Dies bedeutet, dass eine Verschlechterung der Vermögens-, Finanz-, und Ertragslage sowie der Liquidität der BNP PARIBAS S.A. die Wahrscheinlichkeit einer Erteilung nachteiliger Weisungen erhöhen kann.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Schwankungen an den verschiedenen Märkten, wie zum Beispiel Aktien-, Renten- und Rohstoffmärkten, Veränderungen des Zinsniveaus oder maßgeblicher Währungswechselkurse sowie verschärfte Wettbewerbsbedingungen können sich nachteilig auf die Profitabilität der Emittentin auswirken. Erträge und die Aufwendungen der Emittentin sind demnach Schwankungen unterworfen. Der Geschäftsbetrieb der Emittentin ist zwar konzeptionsbedingt ergebnisneutral. Dennoch können Marktschwankungen zu Liquiditätsengpässen bei der Emittentin führen, die wiederum Verluste unter den von der Emittentin begebenen Wertpapieren zur Folge haben können.</li> </ul>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p>- Durch die mit der Emittentin verbundenen Unternehmen, welche sich an einer Transaktion beteiligen können die mit den Wertpapieren in Verbindung steht oder die eine andere Funktion ausüben können, z.B. als Berechnungsstelle, Zahl- und Verwaltungsstelle oder Referenzstelle, sowie durch die Ausgabe weiterer derivativer Instrumente in Verbindung mit dem Basiswert kann es zu potenziellen Interessenkonflikten kommen. Diese Geschäfte können beispielsweise negative Auswirkungen auf den Wert des Basiswertes oder gegebenenfalls auf die diesem zugrunde liegenden Werte haben und sich daher negativ auf die Wertpapiere auswirken.</p> <p>Des Weiteren kann es zu Interessenkonflikten kommen, da die Emittentin und die mit ihr verbundenen Unternehmen nicht öffentliche Informationen in Bezug auf den Basiswert erhalten können und weder die Emittentin noch eines der mit ihr verbundenen Unternehmen verpflichtet sind, solche Informationen an einen Wertpapiergläubiger weiterzuleiten bzw. zu veröffentlichen. Zudem kann ein oder können mehrere mit der Emittentin verbundene(s) Unternehmen Research-Berichte in Bezug auf den Basiswert bzw. auf die im Basiswert enthaltenen Werte publizieren. Diese Tätigkeiten und damit verbundene Interessenkonflikte können sich auf den Wert der Wertpapiere auswirken.</p> <p>- Im Zusammenhang mit dem Angebot und Verkauf der Wertpapiere können die Emittentin oder die mit ihr verbundenen Unternehmen, direkt oder indirekt, Gebühren in unterschiedlicher Höhe an Dritte, zum Beispiel Anlageberater oder Vertriebspartner, zahlen. Solche Gebühren werden gegebenenfalls bei der Festsetzung des Preises des Wertpapiers berücksichtigt und können in diesem damit ohne separaten Ausweis indirekt enthalten sein.</p> <p>- Zwischen der BNP PARIBAS S.A. und der Emittentin besteht ein Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrag. Gemäß § 303 Absatz 1 Aktiengesetz hat die BNP PARIBAS S.A. daher im Falle einer Beendigung des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrages den Wertpapierinhabern der Emittentin für Forderungen Sicherheit zu leisten, die vor der Bekanntmachung der Eintragung der Beendigung des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrages ins Handelsregister begründet worden sind, wenn die Wertpapierinhaber sich innerhalb einer Frist von sechs Monaten seit Bekanntmachung der Eintragung der Beendigung des Beherrschungs- und Gewinnabführungsvertrages zu diesem Zweck bei der BNP PARIBAS S.A. melden. Tun sie dies nicht, verfällt der Forderungsanspruch gegen die BNP PARIBAS S.A.</p>
D.6	Zentrale Risiken bezogen auf die Wertpapiere	<p>Ein Anleger in die Wertpapiere sollte beachten, dass er sein eingesetztes Kapital ganz oder teilweise verlieren kann.</p> <p>Bei den nachfolgenden Risikofaktoren handelt es sich um die wesentlichen Risikofaktoren, die den Wertpapieren eigen sind.</p> <p><u>Basiswert</u></p> <p>Der Wertpapierinhaber trägt das Verlustrisiko im Falle einer ungünstigen Kursentwicklung des zugrundeliegenden Basiswerts. Geschäfte, mit denen Verlustrisiken aus den Wertpapieren ausgeschlossen oder eingeschränkt werden sollen (Absicherungsgeschäfte), können möglicherweise nicht oder nur zu einem verlustbringenden Preis getätigt werden.</p> <p>Die Wertpapiere verbriefen keinen Anspruch auf Zahlung von Dividenden, Ausschüttungen oder ähnlichen Beträgen. Mögliche Wertverluste der Wertpapiere können daher nicht durch andere laufende Erträge der Wertpapiere kompensiert werden.</p> <p>Kursänderungen des Basiswerts (oder auch schon das Ausbleiben einer erwarteten Kursänderung) können den Wert der Wertpapiere bis hin zur Wertlosigkeit mindern. Es besteht dann das Risiko eines Verlusts, der dem gesamten für die Wertpapiere gezahlten Kaufpreis entsprechen kann, einschließlich der aufgewendeten Transaktionskosten.</p> <p>Für den Fall, dass kein Sekundärmarkt für die Wertpapiere zustande kommt, kann die dann fehlende Liquidität im Handel der Wertpapiere unter Umständen zu einem Verlust, bis hin zum Totalverlust führen.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p><u>Vorzeitige Beendigung</u></p> <p>Im Falle einer in den Wertpapierbedingungen vorgesehenen außerordentlichen Kündigung der Wertpapiere durch die Emittentin zahlt die Emittentin an jeden Wertpapierinhaber einen Betrag je Wertpapier ("<b>Kündigungsbetrag</b>"), der als angemessener Marktpreis des Wertpapiers unmittelbar vor dem zur Kündigung berechtigenden Ereignis festgelegt wird. Dabei wird der angemessene Marktpreis des Wertpapiers gemäß den Wertpapierbedingungen von der Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) festgelegt.</p> <p>Es kann nicht ausgeschlossen werden, dass der von der Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) als angemessen festgelegte Marktpreis des Wertpapiers von einem durch einen Dritten festgelegten Marktpreis des Basiswertes oder von auf den Basiswert bezogenen vergleichbaren Optionen oder Wertpapieren abweicht.</p> <p>Unter Umständen kann der Kündigungsbetrag auch erheblich unter dem für das Wertpapier gezahlten Kaufpreis liegen und bis auf Null (0) sinken (Totalverlust des eingesetzten Kapitals).</p> <p><u>Währungsrisiko</u></p> <p>Gegebenenfalls wird/werden die Währung(en) des Basiswertes und die Auszahlungswährung des verbrieften Anspruchs voneinander abweichen. Der Wertpapierinhaber ist einem Wechselkursrisiko ausgesetzt.</p> <p>Im Falle einer in den Wertpapierbedingungen vorgesehenen Quanto Umrechnung, erfolgt eine Umrechnung in die Auszahlungswährung ohne Bezugnahme auf den Wechselkurs zwischen der Währung des Basiswertes und der Auszahlungswährung. Obwohl kein Umrechnungsrisiko besteht, kann der relative Zinsunterschied zwischen dem aktuellen Zinssatz in Bezug auf die Währung des Basiswertes und dem aktuellen Zinssatz in Bezug auf die Auszahlungswährung den Kurs der vorliegenden Wertpapiere negativ beeinflussen.</p> <p><u>Abhängigkeit vom Basiswert</u></p> <p>Wenn der für die Barrierenbetrachtung maßgebliche Kurs, die Barriere erreicht oder unterschritten hat, kann der Auszahlungsbetrag abhängig von der Entwicklung des jeweils zugrundeliegenden Basiswertes, substantiell unter den für ein Wertpapier gezahlten Kaufpreis sinken. Das Wertpapier wirft dann keinen Ertrag ab, sondern beinhaltet das Risiko des Totalverlustes des eingesetzten Betrags bzw. eines Verlusts, der nahezu dem gesamten für ein Wertpapier gezahlten Kaufpreis entspricht.</p> <p>Im Übrigen bestehen unter anderem noch folgende Risiken, die sich negativ auf den Wert des Wertpapiers und entsprechend nachteilig auf den Ertrag des Anlegers bis hin zum Totalverlust auswirken können:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Die Investition in die Wertpapiere stellt keine Direktinvestition in den Basiswert dar. Kursänderungen des Basiswertes (oder das Ausbleiben von erwarteten Kursänderungen) können eine überproportionale negative Wertveränderung der Wertpapiere zur Folge haben.</li> <li>• Provisionen und andere Transaktionskosten führen zu Kostenbelastungen des Wertpapierinhabers, die zu einem Verlust unter den Wertpapieren führen können.</li> <li>• Verschiedenste Einflussfaktoren wie z.B. Änderungen des Marktzinnsniveaus, die Politik der Zentralbanken, die allgemeine wirtschaftliche Entwicklung, die Inflation und unternehmensspezifische Faktoren hinsichtlich der Emittentin wirken sich auf den Kurs der Wertpapiere aus. Diese Faktoren können dazu führen, dass der Kurs der Wertpapiere während der Laufzeit unter den Nennwert bzw. den Kaufpreis fällt und der Anleger im Fall einer Veräußerung vor Fälligkeit einen Verlust erleidet.</li> </ul>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<ul style="list-style-type: none"> <li>• Es kann nicht darauf vertraut werden, dass während der Laufzeit Geschäfte abgeschlossen werden können, durch die die Verlustrisiken aus den Wertpapieren ausgeschlossen oder eingeschränkt werden können. Unter Umständen können solche Geschäfte nicht oder nur zu einem ungünstigen Marktpreis getätigt werden, so dass für den Anleger ein entsprechender Verlust entsteht.</li> <li>• Wenn der Anleger den Erwerb der Wertpapiere mit Kredit finanziert wird, muss er beim Nichteintritt seiner Erwartungen nicht nur den eingetretenen Verlust hinsichtlich des Wertpapiers hinnehmen, sondern er muss auch den Kredit verzinsen und zurückzahlen. Dadurch erhöht sich sein Verlustrisiko erheblich.</li> <li>• Die Emittentin beabsichtigt, unter gewöhnlichen Marktbedingungen regelmäßig Ankaufs- und Verkaufskurse für die Wertpapiere einer Emission stellen zu lassen. Es ist aber nicht gewährleistet, dass die Wertpapiere während der Laufzeit zu einer bestimmten Zeit oder einem bestimmten Kurs erworben oder veräußert werden können.</li> <li>• Es besteht ein Wiederanlagerisiko des Wertpapierinhabers im Fall einer automatischen Kündigung oder einer außerordentlichen Kündigung durch die Emittentin.</li> <li>• Es besteht das Risiko einer negativen Wertbeeinflussung der Wertpapiere durch Marktstörungen. Weiterhin ist zu beachten, dass eine Marktstörung gegebenenfalls die Zahlung des jeweils geschuldeten Betrags an den jeweiligen Anleger verzögern kann.</li> <li>• Jedes Anpassungsereignis stellt ein Risiko der Anpassung oder der Beendigung der Laufzeit der Wertpapiere dar, welches negative Auswirkungen auf den Wert der Wertpapiere haben kann. Im Hinblick auf Anpassungen ist weiterhin zu beachten, dass nicht ausgeschlossen werden kann, dass sich die einer Anpassungsmaßnahme zugrundeliegenden Einschätzungen im Nachhinein als unzutreffend erweisen und sich die Anpassungsmaßnahme später als für den Wertpapierinhaber unvorteilhaft herausstellt.</li> <li>• Es besteht für den Wertpapierinhaber das Risiko, dass jeder Verkauf, Kauf oder Austausch der Wertpapiere Gegenstand einer Besteuerung mit einer Finanztransaktionssteuer werden könnte. Infolge dessen kann gegebenenfalls der Anleger selbst zur Zahlung der Finanztransaktionssteuer oder zum Ausgleich einer Steuerzahlung gegenüber einem an der Transaktion beteiligten Finanzinstitut herangezogen werden.</li> <li>• Die Emittentin und die mit ihr verbundenen Unternehmen könnten möglicherweise verpflichtet sein, gemäß den Regelungen über die Einhaltung der Steuervorschriften für Auslandskonten des US Hiring Incentives to Restore Employment Act 2010 (FATCA) Steuern in Höhe von 30 % auf alle oder einen Teil ihrer Zahlungen einzubehalten. Die Wertpapiere werden in globaler Form von Clearstream verwahrt, so dass ein Einbehalt auf Zahlungen an Clearstream unwahrscheinlich ist. FATCA könnte aber auf die nachfolgende Zahlungskette anzuwenden sein. Sollte infolge von FATCA ein Betrag im Hinblick auf US-Quellensteuern von Zinsen, Kapitalbeträgen oder sonstigen Zahlungen auf die Wertpapiere abzuziehen oder einzubehalten sein, wäre weder die Emittentin noch eine Zahlstelle oder sonstige Person gemäß den Wertpapierbedingungen verpflichtet, infolge des Abzugs oder Einbehalts zusätzliche Beträge an die Investoren zu zahlen.</li> <li>• Die Emittentin und die mit ihr verbundenen Unternehmen könnten zudem möglicherweise verpflichtet sein, gemäß Abschnitt 871(m) des US-Bundessteuergesetzes (Internal Revenue Code) Steuern in Höhe von bis zu 30 % auf alle oder einen Teil ihrer Zahlungen einzubehalten, wenn der für eine Emission von Wertpapieren verwendete Basiswert bzw. Korbbestandteil jeweils Dividenden aus Quellen innerhalb der Vereinigten Staaten von Amerika beinhaltet.</li> </ul>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<ul style="list-style-type: none"> <li>Es besteht ein Steuerrechtsänderungsrisiko, das sich negativ auf den Wert der Wertpapiere auswirken kann. Insbesondere kann nicht ausgeschlossen werden, dass die an Wertpapierinhaber zu zahlenden Beträge aufgrund von steuerrechtlichen Änderungen niedriger ausfallen können als vom Wertpapierinhaber erwartet.</li> </ul>
		<p>Risikohinweis</p> <p>Sollten sich eines oder mehrere der obengenannten Risiken realisieren, könnte dies zu einem erheblichen Kursrückgang der Wertpapiere und im Extremfall zu einem Totalverlust des von den Wertpapierinhabern eingesetzten Kapitals führen.</p>

### Abschnitt E - Angebot

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
E.2b	Gründe für das Angebot und Zweckbestimmung der Erlöse	Im Rahmen des Angebots steht die Gewinnerzielung im Vordergrund. Die Emittentin wird den Nettoerlös der Emission in jedem Fall ausschließlich zur Absicherung ihrer Verbindlichkeiten gegenüber den Wertpapiergläubigern unter den Wertpapieren verwenden.
E.3	Angebotskonditionen	<p>Die Wertpapiere werden von der BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C., Paris, Frankreich ab dem 20. Oktober 2016 interessierten Anlegern angeboten. Das öffentliche Angebot endet mit Ablauf der Gültigkeit des Prospekts.</p> <p>Der anfängliche Ausgabepreis des Wertpapiers je Serie von Wertpapieren und das Gesamtvolumen je Serie von Wertpapieren ist:</p>

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen	ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PB9TZU5	47,98	1.000.000	DE000PB9T0Z7	55,98	1.000.000
DE000PB9TZV3	51,22	1.000.000	DE000PB9T002	50,46	1.000.000
DE000PB9TZW1	48,30	1.000.000	DE000PB9T010	46,21	1.000.000
DE000PB9TZX9	56,12	1.000.000	DE000PB9T028	49,88	1.000.000
DE000PB9TZY7	63,93	1.000.000	DE000PB9T036	49,26	1.000.000
DE000PB9TZZ4	50,51	1.000.000	DE000PB9T044	47,23	1.000.000
DE000PB9TZ00	56,80	1.000.000	DE000PB9T051	36,66	1.000.000
DE000PB9TZ18	49,21	1.000.000	DE000PB9T069	46,66	1.000.000
DE000PB9TZ26	57,68	1.000.000	DE000PB9T077	39,42	1.000.000
DE000PB9TZ34	66,14	1.000.000	DE000PB9T085	49,09	1.000.000
DE000PB9TZ42	51,79	1.000.000	DE000PB9T093	44,88	1.000.000
DE000PB9TZ59	37,01	1.000.000	DE000PB9T1A8	56,21	1.000.000
DE000PB9TZ67	47,41	1.000.000	DE000PB9T1B6	46,75	1.000.000
DE000PB9TZ75	39,89	1.000.000	DE000PB9T1C4	51,02	1.000.000
DE000PB9TZ83	50,11	1.000.000	DE000PB9T1D2	47,63	1.000.000
DE000PB9TZ91	45,71	1.000.000	DE000PB9T1F7	39,31	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen	ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PB9T0A0	58,10	1.000.000	DE000PB9T1G5	50,80	1.000.000
DE000PB9T0B8	47,83	1.000.000	DE000PB9T1H3	37,67	1.000.000
DE000PB9T0C6	52,73	1.000.000	DE000PB9T1J9	46,35	1.000.000
DE000PB9T0D4	49,02	1.000.000	DE000PB9T1K7	42,82	1.000.000
DE000PB9T0E2	40,13	1.000.000	DE000PB9T1L5	52,93	1.000.000
DE000PB9T0F9	52,10	1.000.000	DE000PB9T1M3	44,90	1.000.000
DE000PB9T0G7	38,40	1.000.000	DE000PB9T1N1	52,72	1.000.000
DE000PB9T0H5	47,37	1.000.000	DE000PB9T1P6	40,40	1.000.000
DE000PB9T0J1	43,63	1.000.000	DE000PB9T1Q4	51,05	1.000.000
DE000PB9T0K9	54,06	1.000.000	DE000PB9T1R2	46,18	1.000.000
DE000PB9T0L7	45,65	1.000.000	DE000PB9T1S0	58,89	1.000.000
DE000PB9T0M5	53,55	1.000.000	DE000PB9T1T8	47,77	1.000.000
DE000PB9T0N3	38,64	1.000.000	DE000PB9T1U6	36,16	1.000.000
DE000PB9T0P8	49,80	1.000.000	DE000PB9T1V4	45,72	1.000.000
DE000PB9T0Q6	37,06	1.000.000	DE000PB9T1W2	38,82	1.000.000
DE000PB9T0R4	45,55	1.000.000	DE000PB9T1X0	48,04	1.000.000
DE000PB9T0S2	42,14	1.000.000	DE000PB9T1Y8	44,13	1.000.000
DE000PB9T0T0	52,06	1.000.000	DE000PB9T1Z5	54,85	1.000.000
DE000PB9T0U8	44,26	1.000.000	DE000PB9T101	46,09	1.000.000
DE000PB9T0V6	52,05	1.000.000	DE000PB9T119	54,10	1.000.000
DE000PB9T0W4	47,58	1.000.000	DE000PB9T127	47,24	1.000.000
DE000PB9T0X2	58,82	1.000.000	DE000PB9T135	49,78	1.000.000
DE000PB9T0Y0	45,56	1.000.000			

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p>Die Emittentin behält sich das Recht vor, die Emission der Wertpapiere ohne Angabe von Gründen nicht vorzunehmen.</p> <p>Die Lieferung der Wertpapiere erfolgt zum Zahltag/Valutatag bzw. Emissionstermin.</p>
E.4	Interessen von natürlichen oder juristischen Personen, die bei der Emission/dem Angebot beteiligt sind einschließlich Interessenkonflikten	<p>Die Anbieterin BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C. kann sich von Zeit zu Zeit für eigene Rechnung oder für Rechnung eines Kunden an Transaktionen beteiligen, die mit den Wertpapieren in Verbindung stehen. Ihre Interessen im Rahmen solcher Transaktionen können ihrem Interesse in der Funktion als Anbieterin widersprechen.</p> <p>BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C. ist Gegenpartei (die "<b>Gegenpartei</b>") bei Deckungsgeschäften bezüglich der Verpflichtungen der Emittentin aus den Wertpapieren. Daher können hieraus Interessenkonflikte resultieren zwischen der BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C. und den Anlegern hinsichtlich (i) ihrer Pflichten als Berechnungsstelle bei der Ermittlung der Kurse der Wertpapiere und anderen damit verbundenen Feststellungen und (ii) ihrer Funktion als Anbieterin und Gegenpartei.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		Zudem kann und wird die BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C. in Bezug auf die Wertpapiere eine andere Funktion als die der Anbieterin, Berechnungsstelle und Gegenpartei ausüben, z.B. als Zahl- und Verwaltungsstelle.
E.7	Schätzung der Ausgaben, die dem Anleger vom Emittenten oder Anbieter in Rechnung gestellt werden	<p>Entfällt.</p> <p>Der Anleger kann die Wertpapiere zum Ausgabepreis bzw. zum Verkaufspreis erwerben. Dem Anleger werden über den Ausgabepreis bzw. den Verkaufspreis hinaus keine weiteren Kosten durch die Emittentin in Rechnung gestellt; vorbehalten bleiben jedoch Kosten, die dem Erwerber im Rahmen des Erwerbs der Wertpapiere über Banken und Sparkassen oder sonstige Vertriebswege entstehen können und über die weder die Emittentin noch die Anbieterin eine Aussage treffen können.</p> <p>Zudem sind im Ausgabepreis bzw. dem Verkaufspreis die mit der Ausgabe und dem Vertrieb der Wertpapiere verbundenen Kosten der Emittentin (z.B. Vertriebskosten, Strukturierungskosten und Absicherungskosten, einschließlich einer Ertragsmarge für die Emittentin) enthalten.</p>