

**BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH,  
Frankfurt am Main**

**Endgültige Angebotsbedingungen Nr. 1182  
vom 9. November 2016**

**im Zusammenhang mit dem Basisprospekt vom 23. Mai 2016 zur Begebung von  
Optionsscheinen bezogen auf Indizes, Aktien, Währungen, Metalle, Futureskontrakte,  
und/oder American Depositary Receipts, Global Depositary Receipts**

**zur Begebung von**

**MINI Future Long bzw. MINI Future Short Optionsscheinen**

**bezogen auf Währungen**

**angeboten durch  
BNP Paribas Arbitrage S.N.C.,  
Paris, Frankreich**

Dieses Dokument enthält die endgültigen Angaben zu den Wertpapieren und die Endgültigen Optionsscheinbedingungen und stellt die Endgültigen Bedingungen des Angebotes von MINI Future Long bzw. MINI Future Short Optionsscheinen bezogen auf Währungen (im Nachfolgenden auch als "Basiswert" bezeichnet) dar.

Die Optionsscheinbedingungen für die betreffende Serie sind in einen Abschnitt A (Produktspezifische Bedingungen) und einen Abschnitt B (Allgemeine Bedingungen) aufgeteilt. Der Abschnitt A der Optionsscheinbedingungen ist durch die nachfolgenden Endgültigen Bedingungen vervollständigt. Der Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen ist bereits vollständig im Basisprospekt im Abschnitt X. Optionsscheinbedingungen 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 23. Mai 2016 (wie nachgetragen durch die Nachträge vom 13. Juni 2016, vom 22. Juli 2016, vom 8. August 2016 und vom 28. Oktober 2016 einschließlich etwaiger zukünftiger Nachträge) und einschließlich der per Verweis einbezogenen Dokumente zu lesen.

Der vorgenannte Basisprospekt vom 23. Mai 2016, unter dem die in diesen Endgültigen Angebotsbedingungen beschriebenen Optionsscheine begeben werden, verliert am 23. Mai 2017 seine Gültigkeit. Ab diesem Zeitpunkt sind diese Endgültigen Angebotsbedingungen für diejenigen Optionsscheine, deren Laufzeit bis zum 23. Mai 2017 nicht beendet worden ist, im Zusammenhang mit dem jeweils aktuellsten Basisprospekt der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt am Main, für Optionsscheine bezogen auf Indizes, Aktien, Währungen, Metalle, Futureskontrakte, und/oder American Depositary Receipts, Global Depositary Receipts zu lesen, der dem Basisprospekt vom 23. Mai 2016 nachfolgt (jeweils ein Nachfolgender Basisprospekt).

Der jeweils Nachfolgende Basisprospekt der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt am Main, für Optionsscheine bezogen auf Indizes, Aktien, Währungen, Metalle, Futureskontrakte, und/oder American Depositary Receipts, Global Depositary Receipts wird auf der Internetseite der Emittentin unter [www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte](http://www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte) veröffentlicht.

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

Der Basisprospekt, die per Verweis einbezogenen Dokumente und etwaige Nachträge zum Basisprospekt sowie die Endgültigen Bedingungen der Optionsscheine sind am Sitz der Emittentin, Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main kostenlos erhältlich und können auf der Webseite [www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte](http://www.derivate.bnpparibas.com/service/basisprospekte) bzw. die Endgültigen Bedingungen auf der Webseite [www.derivate.bnpparibas.com/optionsscheine](http://www.derivate.bnpparibas.com/optionsscheine) 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 Optionsscheinen die endgültigen Optionsscheinbedingungen dar (die "Endgültigen Optionsscheinbedingungen"). Sofern und soweit die im Basisprospekt enthaltenen Optionsscheinbedingungen von den Endgültigen Optionsscheinbedingungen abweichen, sind die Endgültigen Optionsscheinbedingungen maßgeblich.

### **ANGABEN ÜBER DEN BASISWERT**

Der den Optionsscheinen zugewiesene Basiswert ist der Tabelle in den Optionsscheinbedingungen (§ 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>
EUR/USD Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/CHF Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/GBP Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
USD/JPY Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/JPY Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/TRY Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>

Der jeweils aktuelle Wechselkurs ("Bloomberg BFIX rate") basierend auf der gegenwärtig um 14:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) stattfindenden Preisfeststellung kann unter <http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings> abgerufen werden.

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

## ENDGÜLTIGE OPTIONSSCHEINBEDINGUNGEN

Der für die Optionsscheine geltende Abschnitt A, §§ 1-4 (Produktspezifische Bedingungen) der Endgültigen Optionsscheinbedingungen ist nachfolgend aufgeführt. Der für die Optionsscheine geltende Abschnitt B der Endgültigen Optionsscheinbedingungen ist dem Abschnitt B §§ 5-11 (Allgemeine Bedingungen) der Optionsscheinbedingungen des Basisprospekts zu entnehmen.

Die Inhaber-Sammelurkunde verbrieft mehrere Optionsscheine ("**Serienemission**"), die sich lediglich in der wirtschaftlichen Ausgestaltung des in § 1 gewährten Optionsrechts unterscheiden. Die unterschiedlichen Ausstattungsmerkmale je Optionsschein sind in der Tabelle am Ende des § 1 dargestellt und der einzelnen Emission von Optionsscheinen zugewiesen. Die nachfolgenden Optionsscheinbedingungen finden daher in Bezug auf jeden Optionsschein einer Serienemission nach Maßgabe dieser Tabelle entsprechend Anwendung.

### § 1

#### Optionsrecht, Definitionen

- (1) Die BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH, Frankfurt am Main ("**Emittentin**") gewährt jedem Inhaber ("**Optionsscheininhaber**") eines MINI Future Long Optionsscheines bzw. MINI Future Short Optionsscheines ("**Optionsschein**", zusammen "**Optionsscheine**") bezogen auf den Basiswert ("**Basiswert**"), der in der am Ende dieses § 1 dargestellten Tabelle aufgeführt ist, das Recht ("**Optionsrecht**"), von der Emittentin nach Maßgabe dieser Optionsscheinbedingungen Zahlung des in Absatz (2) und Absatz (4) bezeichneten Auszahlungsbetrages in EUR ("**Auszahlungswährung**") gemäß § 1 dieser Optionsscheinbedingungen und § 7 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zu verlangen.
- (2) Vorbehaltlich eines Stop Loss Ereignisses und der Regelung des Absatzes (3) ist der Auszahlungsbetrag ("**Auszahlungsbetrag**") im Fall eines **MINI Future Long** Optionsscheines der in der Referenzwährung bestimmte Differenzbetrag zwischen dem Referenzpreis und dem Maßgeblichen Basispreis, multipliziert mit dem als Dezimalzahl ausgedrückten Bezugsverhältnis ("**Maßgeblicher Betrag**"):

$$\text{Maßgeblicher Betrag} = (\text{Referenzpreis} - \text{Maßgeblicher Basispreis}) \times (\text{B})$$

Es erfolgt eine Kaufmännische Rundung des so ermittelten Auszahlungsbetrages auf die zweite Nachkommastelle. Der Maßgebliche Betrag wird nach Maßgabe von § 1 Absatz (7) in die Auszahlungswährung umgerechnet, sofern die Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Ist der so ermittelte Maßgebliche Betrag Null oder ein negativer Wert, so entspricht der Auszahlungsbetrag lediglich 1/10 Eurocent pro Optionsschein ("**Mindestbetrag**"). Hält ein Optionsscheininhaber mehrere Optionsscheine, so erfolgt eine Kaufmännische Rundung bezogen auf die Summe der entsprechenden Mindestbeträge auf die zweite Nachkommastelle.

- (3) Wenn der Beobachtungskurs innerhalb des Beobachtungszeitraums (einschließlich des Zeitpunkts der Feststellung des Referenzpreises) die Stop Loss Schwelle erreicht oder unterschreitet und damit ein Stop Loss Ereignis eintritt, gelten die Optionsscheine als automatisch ausgeübt und der Tag des Eintritts des Stop Loss Ereignisses, spätestens jedoch der Tag der Feststellung des Stop Loss Referenzstands, ist gleichzeitig der Bewertungstag. Der Auszahlungsbetrag ermittelt sich in diesem Falle ausschließlich (und unabhängig davon, ob zuvor eine Ausübungserklärung im Sinne von § 2 abgegeben wurde oder nicht) wie folgt:

$$\text{Auszahlungsbetrag} = (\text{Stop Loss Referenzstand} - \text{Maßgeblicher Basispreis}) \times (\text{B})$$

Es erfolgt eine Kaufmännische Rundung des so ermittelten Auszahlungsbetrages auf die zweite Nachkommastelle. Der maßgebliche Betrag wird nach Maßgabe von § 1 Absatz (7) in die Auszahlungswährung umgerechnet, sofern die Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Der Auszahlungsbetrag kann lediglich dem Mindestbetrag entsprechen, wenn der Stop Loss Referenzstand kleiner oder gleich dem Maßgeblichen Basispreis ist. Hält ein Optionsscheininhaber mehrere Optionsscheine, so erfolgt eine Kaufmännische Rundung bezogen auf die Summe der entsprechenden Mindestbeträge auf die zweite Nachkommastelle.

- (4) Vorbehaltlich eines Stop Loss Ereignisses und der Regelung des Absatzes (5) ist der Auszahlungsbetrag ("**Auszahlungsbetrag**") im Fall eines **MINI Future Short** Optionsscheines der in der Referenzwährung bestimmte Differenzbetrag, zwischen dem Maßgeblichen Basispreis und dem Referenzpreis, multipliziert mit dem als Dezimalzahl ausgedrückten Bezugsverhältnis ("**Maßgeblicher Betrag**"):

$$\text{Maßgeblicher Betrag} = (\text{Maßgeblicher Basispreis} - \text{Referenzpreis}) \times (\text{B})$$

Es erfolgt eine Kaufmännische Rundung des so ermittelten Auszahlungsbetrages auf die zweite Nachkommastelle. Der Maßgebliche Betrag wird nach Maßgabe von § 1 Absatz (7) in die Auszahlungswährung umgerechnet, sofern die Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Ist der so ermittelte Maßgebliche Betrag Null oder ein negativer Wert, so entspricht der Auszahlungsbetrag lediglich 1/10 Eurocent pro Optionsschein ("**Mindestbetrag**"). Hält ein Optionsscheininhaber mehrere Optionsscheine, so erfolgt eine Kaufmännische Rundung bezogen auf die Summe der entsprechenden Mindestbeträge auf die zweite Nachkommastelle.

- (5) Wenn der Beobachtungskurs innerhalb des Beobachtungszeitraums (einschließlich des Zeitpunkts der Feststellung des Referenzpreises) die Stop Loss Schwelle erreicht oder überschreitet und damit ein Stop Loss Ereignis eintritt, gelten die Optionsscheine als automatisch ausgeübt und der Tag des Eintritts des Stop Loss Ereignisses, spätestens jedoch der Tag der Feststellung des Stop Loss Referenzstands, ist gleichzeitig der Bewertungstag. Der Auszahlungsbetrag ermittelt sich in diesem Falle ausschließlich (und unabhängig davon, ob zuvor eine Ausübungserklärung im Sinne von § 2 abgegeben wurde oder nicht) wie folgt:

$$\text{Auszahlungsbetrag} = (\text{Maßgeblicher Basispreis} - \text{Stop Loss Referenzstand}) \times (\text{B})$$

Es erfolgt eine Kaufmännische Rundung des so ermittelten Auszahlungsbetrages auf die zweite Nachkommastelle. Der maßgebliche Betrag wird nach Maßgabe von § 1 Absatz (7) in die Auszahlungswährung umgerechnet, sofern die Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Der Auszahlungsbetrag kann lediglich dem Mindestbetrag entsprechen, wenn der Stop Loss Referenzstand größer oder gleich dem Maßgeblichen Basispreis ist. Hält ein Optionsscheininhaber mehrere Optionsscheine, so erfolgt eine Kaufmännische Rundung bezogen auf die Summe der entsprechenden Mindestbeträge auf die zweite Nachkommastelle.

Die Emittentin wird spätestens am Fälligkeitstag den Auszahlungsbetrag pro Optionsschein an den Optionsscheininhaber zahlen.

- (6) Im Sinne dieser Optionsscheinbedingungen bedeutet:

"**Anfänglicher Basispreis**": ist der dem Optionsschein in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Anfängliche Basispreis und dient bei der ersten Anpassung zur Berechnung des Maßgeblichen Basispreises.

"**Anpassungstag ("T")**": sind die im Finanzierungszeitraum tatsächlich angefallenen Kalendertage dividiert durch 360.

"**Ausübungstag**": ist jeweils der letzte Bankgeschäftstag eines jeden Monats, beginnend mit dem 30. November 2016.

"**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.

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

"**Beobachtungskurs**": ist jeder innerhalb des Beobachtungszeitraums von der Berechnungsstelle festgestellte und auf der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle aufgeführten Reutersseite veröffentlichte Kurs des Basiswerts.

**"Beobachtungszeitraum"**: ist jeweils an jedem Handelstag von Montag 00:00:01 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) bis Freitag 23:59:59 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) (jeweils einschließlich). Der erste Beobachtungszeitraum beginnt am 10. November 2016 um 08:00:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main).

Der erste und jeder weitere Beobachtungszeitraum endet jeweils freitags um 23:59:59 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) bzw. mit der Feststellung des Referenzpreises oder des Stop Loss Ereignisses (jeweils einschließlich).

Für den Beginn des Beobachtungszeitraums gilt § 4 entsprechend. Sollte zum Beginn des Beobachtungszeitraumes ein unter Beobachtungskurs definierter Kurs des Basiswerts nicht festgestellt werden und liegt keine Marktstörung gemäß § 4 vor, dann beginnt der Beobachtungszeitraum, sobald ein solcher Kurs für den jeweiligen Beobachtungszeitraum festgestellt ist.

**"Bewertungstag"**: ist der früheste der folgenden Tage:

- (a) der Ausübungstag;
- (b) der Kündigungstermin, zu dem die Emittentin die Kündigung gemäß § 2 erklärt; und
- (c) der Tag an dem ein Stop Loss Ereignis eintritt, spätestens jedoch der Tag, an dem der Stop Loss Referenzstand ermittelt wird.

Ist der Bewertungstag kein Handelstag, dann gilt der unmittelbar nachfolgende Handelstag als Bewertungstag.

Im Falle einer Marktstörung im Sinne des § 4 wird der Bewertungstag **maximal** um acht Handelstage verschoben.

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

**"Börsengeschäftstag"**: ist jeder Tag, an dem die Börse, an der die in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle aufgeführten Optionsscheine einbezogen wurden für den Handel geöffnet ist.

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

**"Fälligkeitstag"**: ist der Tag, der vier Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag liegt.

**"Finanzierungszeitraum"**: ist der Zeitraum zwischen dem Zeitpunkt, an dem der Maßgebliche Basispreis zuletzt neu ermittelt wurde - der Zeitpunkt der aktuellen Anpassung des Maßgeblichen Basispreises bleibt hierbei außer Betracht - bis zum Zeitpunkt unmittelbar vor der aktuellen Anpassung des Maßgeblichen Basispreises.

**"Fremdwährung"**: Mit Fremdwährung wird jede Währung bezeichnet, die nicht EUR ist.

**"Handelstag"**: ist

- (a) im Hinblick auf die Feststellung des Referenzpreises jeder Tag, an dem die Referenzstelle geöffnet ist und an dem der Kurs des Basiswertes festgestellt wird,
- (b) im Hinblick auf die Feststellung des Beobachtungskurses jeder Tag, an dem die Berechnungsstelle den Beobachtungskurs feststellt.

**"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.

**"Maßgeblicher Basispreis"**: entspricht zunächst dem Anfänglichen Basispreis. Anschließend wird er von der Berechnungsstelle zu jedem Anpassungstag jeweils um 22:00:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) angepasst und gilt dann jeweils ab diesem Zeitpunkt bis zum nächsten Anpassungstag um 21:59:59 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main). Der nach dem Anfänglichen Basispreis neue Maßgebliche Basispreis wird wie folgt ermittelt, wobei eine Kaufmännische Rundung auf die vierte Nachkommastelle erfolgt:

Im Falle eines **MINI Future Long** Optionsscheines:

$$\text{Maßgeblicher Basispreis}_{\text{neu}} = \text{Maßgeblicher Basispreis}_{\text{Vorangehend}} \times (1 + (R + \text{Zinsanpassungssatz}) \times T)$$

("R"= Referenzzinssatz und "T"= Anzahl der Kalendertage im jeweiligen Finanzierungszeitraum, dividiert durch 360, wobei die ersten zwei Stunden (22:00 Uhr bis 24:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) des betreffenden Anpassungstages) nicht und die Tage Montag, Dienstag, Mittwoch und Donnerstag mit jeweils einem Kalendertag und der Freitag wochenendbedingt mit jeweils drei Kalendertagen berücksichtigt werden.)

Im Falle eines **MINI Future Short** Optionsscheines:

$$\text{Maßgeblicher Basispreis}_{\text{neu}} = \text{Maßgeblicher Basispreis}_{\text{Vorangehend}} \times (1 + (R - \text{Zinsanpassungssatz}) \times T)$$

("R"= Referenzzinssatz und "T"= Anzahl der Kalendertage im jeweiligen Finanzierungszeitraum, dividiert durch 360, wobei die ersten zwei Stunden (22:00 Uhr bis 24:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) des betreffenden Anpassungstages) nicht und die Tage Montag, Dienstag, Mittwoch und Donnerstag mit jeweils einem Kalendertag und der Freitag wochenendbedingt mit jeweils drei Kalendertagen berücksichtigt werden.)

**"Maßgeblicher Basispreis<sub>Vorangehend</sub>"**: bezeichnet den Maßgeblichen Basispreis des Tages, an dem der aktuelle Referenzzinssatz zuletzt festgelegt wurde; der Tag der aktuellen Anpassung des Maßgeblichen Basispreises bleibt hierbei außer Betracht.

**"Referenzpreis"**: für die Wechselkurspaare EUR/Fremdwährung ist jeweils der von der Referenzstelle gegenwärtig um 14:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) festgestellte und auf der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle aufgeführten Internetseite veröffentlichte Kurs des Basiswerts.

**"Referenzpreis"**: für die Wechselkurspaare Fremdwährung 1/Fremdwährung 2 wird der Referenzpreis durch die Berechnungsstelle auf Grundlage der offiziellen Wechselkurse, die für EUR/Fremdwährung 1 und EUR/Fremdwährung 2 von der Referenzstelle am Bewertungstag festgestellt werden, ermittelt, sofern die Referenzstelle regelmäßig keinen Wechselkurs für Fremdwährung1/Fremdwährung 2 feststellt und veröffentlicht.

Die Berechnung erfolgt, indem der Wechselkurs für EUR/Fremdwährung 2 durch den Wechselkurs für EUR/Fremdwährung 1 dividiert wird.

$$\frac{\text{Wechselkurs EUR / Fremdwährung2}}{\text{Wechselkurs EUR / Fremdwährung1}}$$

Sofern die Referenzstelle regelmäßig einen Wechselkurs für Fremdwährung1/Fremdwährung 2 feststellt und veröffentlicht, ist der Referenzpreis jeweils der von der Referenzstelle gegenwärtig um 14:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) 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 § 4 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.

**"Referenzzinssatz" ("R")**: ist in Bezug auf die jeweilige Ermittlung des Maßgeblichen Basispreises<sub>neu</sub> und jeweils in Bezug auf den entsprechenden Anpassungstag die Differenz zwischen dem (dem Basiswert in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle) zugewiesenen Referenzzinssatz 1, wie er auf der jeweiligen Reutersseite 1 veröffentlicht wird und Referenzzinssatz 2, wie er auf der jeweiligen Reutersseite 2 veröffentlicht wird. Die jeweilige Reutersseite ist dem jeweiligen Referenzzinssatz in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugeordnet.

Eine Neuberechnung des Referenzzinssatzes erfolgt jeweils nur, wenn beide Zinssätze für den jeweiligen Anpassungstag festgestellt und veröffentlicht werden. Ist dies nicht der Fall, wird für die vorliegende Berechnung der in Bezug auf die Ermittlung des jeweiligen Maßgeblichen Basispreises<sub>Vorangehend</sub> festgestellte Referenzzinssatz verwendet.

Für den Fall, dass ein Zinssatz in Bezug auf einen Anpassungstag künftig mehrmals festgelegt und veröffentlicht wird, bestimmt die Berechnungsstelle nach billigem Ermessen (§ 317 BGB), welcher dieser Zinssätze für die Berechnung des Referenzzinssatzes künftig maßgeblich sein soll und wo er für die Zwecke der Ermittlung des Referenzzinssatzes veröffentlicht wird, die Emittentin gibt diese Entscheidung gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt.

Für den Fall, dass es bei der Ermittlung von mindestens einem der Zinssätze oder bei der sie ermittelnden Stelle zu einer Änderung kommt, die Einfluss auf die Höhe des betreffenden Zinssatzes hat oder haben kann, wird die Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) einen Zinssatz oder beide Zinssätze der/die für die Ermittlung der Differenz bzw. des Referenzzinssatzes maßgeblich ist/sind, ersetzen. Den neuen Zinssatz bzw. die neuen Zinssätze wird die Emittentin gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekanntgeben.

**"Stop Loss Ereignis"**: ist im Fall eines **MINI Future Long** Optionsscheines das Ereignis, wenn der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Stop Loss Schwelle erreicht oder unterschreitet.

**"Stop Loss Ereignis"**: ist im Fall eines **MINI Future Short** Optionsscheines das Ereignis, wenn der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Stop Loss Schwelle erreicht oder überschreitet.

**"Stop Loss Referenzstand"**: ist der Kurs, der nach Eintritt eines Stop Loss Ereignisses von der Berechnungsstelle nach billigem Ermessen (§ 317 BGB) auf der Grundlage der festgestellten Kurse und unter Berücksichtigung der Absicherungsgeschäfte der Berechnungsstelle spätestens am Handelstag nach dem Tag des Eintritts des Stop Loss Ereignisses als der Stop Loss Referenzstand bestimmt wird.

**"Stop Loss Schwelle"**: ist die dem Optionsschein zugewiesene Stop Loss Schwelle. Die anfängliche Stop Loss Schwelle ist die in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Stop Loss Schwelle (die **"Anfängliche Stop Loss Schwelle"**). Die Stop Loss Schwelle (einschließlich der Anfänglichen Stop Loss Schwelle) wird bei Anpassung des Maßgeblichen Basispreises wie folgt neu festgelegt, wobei eine Kaufmännische Rundung auf die vierte Nachkommastelle erfolgt:

#### **Maßgeblicher Basispreis x Stop Loss Schwellen Anpassungssatz**

**"Stop Loss Schwellen Anpassungssatz"**: ist der dem Optionsschein in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Anpassungssatz.

**"Zinsanpassungssatz"**: ist der dem jeweiligen Optionsschein zugewiesene Zinsanpassungssatz. Der anfängliche Zinsanpassungssatz ist der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle zugewiesene Zinsanpassungssatz (**"Anfänglicher Zinsanpassungssatz"**). Die Emittentin ist berechtigt, den Zinsanpassungssatz, einschließlich des Anfänglichen Zinsanpassungssatzes an jedem Börsengeschäftstag nach ihrem billigen Ermessen (§ 315 BGB) innerhalb einer in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle für jeden Optionsschein angegebenen Bandbreite (Abweichung jeweils (+) oder (-)) unter Berücksichtigung der jeweiligen Marktbedingungen (einschließlich Marktzinsniveau und Zinserwartungen des Marktes) neu festzulegen. Der angepasste Wert wird unverzüglich gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) veröffentlicht.

- (7) Die nachfolgenden Bestimmungen zur Währungsumrechnung finden dann Anwendung, wenn die Referenzwährung nicht der Auszahlungswährung entspricht.

Für die Umrechnung von der Referenzwährung in die Auszahlungswährung ist der am Bewertungstag von Bloomberg für diesen Tag festgelegte und auf der Bloomberg-Seite BFIX veröffentlichte Wechselkurs maßgeblich.

Sollte die Bloombergseite BFIX nicht mehr von der Emittentin oder der Berechnungsstelle für die Umrechnung von der Referenzwährung in die Auszahlungswährung genutzt werden können, so ist der Wechselkurs, der auf einer anderen von der Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) ausgewählten Seite ("Ersatzseite") veröffentlicht wird, maßgeblich. Die Emittentin wird die Ersatzseite unverzüglich gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt machen.

Sollte die Ermittlung eines Wechselkurses entweder dauerhaft eingestellt oder dauerhaft nicht mehr auf die vorstehend beschriebene Weise veröffentlicht werden, so wird die Emittentin durch Bekanntmachung gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) unverzüglich nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) und unter Berücksichtigung der gängigen Marktusancen einen anderen Kurs als Wechselkurs festlegen.



Umrechnung im Fall eines Stop Loss Ereignisses:

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 10 (MINI Future Long/Short Optionsscheine)

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz*/ Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
									2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)		
PR0DEK, DE000PR0DEK6 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0757	1,0865	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEL, DE000PR0DEL4 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0767	1,0875	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEM, DE000PR0DEM2 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0777	1,0885	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEN, DE000PR0DEN0 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0787	1,0895	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEP, DE000PR0DEP5 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0797	1,0905	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEQ, DE000PR0DEQ3 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0807	1,0915	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DER, DE000PR0DER1 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0817	1,0925	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DES, DE000PR0DES9 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0827	1,0935	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DET, DE000PR0DET7 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0837	1,0945	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEU, DE000PR0DEU5 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0847	1,0955	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEV, DE000PR0DEV3 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0857	1,0966	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEW, DE000PR0DEW1 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0867	1,0976	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DEX, DE000PR0DEX9 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0877	1,0986	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEY, DE000PR0DEY7 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0887	1,0996	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DEZ, DE000PR0DEZ4 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0897	1,1006	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DE0, DE000PR0DE08 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0907	1,1016	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DE1, DE000PR0DE16 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0917	1,1026	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=
PR0DE2, DE000PR0DE24 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	USD	Bloomberg L.P.	100	1,0927	1,1036	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EUR=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DE3, DE000PR0DE32 / 1.000.000	EUR/CHF Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	CHF	Bloomberg L.P.	100	1,0464	1,0778	103,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:CHF-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: CHFLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURCHF=
PR0DE4, DE000PR0DE40 / 1.000.000	EUR/GBP Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	GBP	Bloomberg L.P.	100	0,8777	0,8865	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:GBP-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: GBPLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURGBP=
PR0DE5, DE000PR0DE57 / 1.000.000	EUR/GBP Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	GBP	Bloomberg L.P.	100	0,8827	0,8915	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:GBP-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: GBPLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURGBP=
PR0DE6, DE000PR0DE65 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	JPY	Bloomberg L.P.	100	100,5529	101,5584	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Geldkurs JPY=
PR0DE7, DE000PR0DE73 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	JPY	Bloomberg L.P.	100	101,0529	102,0634	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Geldkurs JPY=
PR0DE8, DE000PR0DE81 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	JPY	Bloomberg L.P.	100	101,5529	102,5684	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Geldkurs JPY=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DE9, DE000PR0DE99 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	JPY	Bloomberg L.P.	100	102,0529	103,0734	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Geldkurs JPY=
PR0DFA, DE000PR0DFA4 / 1.000.000	EUR/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	JPY	Bloomberg L.P.	100	112,0084	113,1285	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURJPY=
PR0DFB, DE000PR0DFB2 / 1.000.000	EUR/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	JPY	Bloomberg L.P.	100	112,5084	113,6335	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURJPY=
PR0DFC, DE000PR0DFC0 / 1.000.000	EUR/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	JPY	Bloomberg L.P.	100	113,0084	114,1385	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURJPY=
PR0DFD, DE000PR0DFD8 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,3376	3,3710	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURTRY=
PR0DFE, DE000PR0DFE6 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Long	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,3676	3,4013	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURTRY=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DF, DE000PR0DF3 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/markets/currencies/fixings	Long	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,3976	3,4316	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURTRY=
PR0DFG, DE000PR0DFG1 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/markets/currencies/fixings	Long	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,4276	3,4619	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURTRY=
PR0DFH, DE000PR0DFH9 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/markets/currencies/fixings	Long	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,4576	3,4922	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURTRY=
PR0DFJ, DE000PR0DFJ5 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/markets/currencies/fixings	Long	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,4876	3,5225	101,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Geldkurs EURTRY=
PR0DFK, DE000PR0DFK3 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/markets/currencies/fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1412	1,1298	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFL, DE000PR0DFL1 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/markets/currencies/fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1402	1,1288	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DFM, DE000PR0DFM9 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1392	1,1278	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFN, DE000PR0DFN7 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1382	1,1268	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFP, DE000PR0DFP2 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1372	1,1258	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFQ, DE000PR0DFQ0 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1362	1,1248	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFR, DE000PR0DFR8 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1352	1,1238	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFS, DE000PR0DFS6 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1342	1,1229	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=



WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DFT, DE000PR0DFT4 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1332	1,1219	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFU, DE000PR0DFU2 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1322	1,1209	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFV, DE000PR0DFV0 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1312	1,1199	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFW, DE000PR0DFW8 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1302	1,1189	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFX, DE000PR0DFX6 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1292	1,1179	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DFY, DE000PR0DFY4 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1282	1,1169	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DFZ, DE000PR0DFZ1 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1272	1,1159	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF0, DE000PR0DF07 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1262	1,1149	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF1, DE000PR0DF15 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1252	1,1139	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF2, DE000PR0DF23 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1242	1,1130	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF3, DE000PR0DF31 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1232	1,1120	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF4, DE000PR0DF49 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1222	1,1110	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DF5, DE000PR0DF56 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1212	1,1100	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF6, DE000PR0DF64 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1202	1,1090	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF7, DE000PR0DF72 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1192	1,1080	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF8, DE000PR0DF80 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1182	1,1070	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DF9, DE000PR0DF98 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1172	1,1060	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=
PR0DGA, DE000PR0DGA2 / 1.000.000	EUR/USD Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	USD	Bloomberg L.P.	100	1,1162	1,1050	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:USD-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: USDLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EUR=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DGB, DE000PR0DGB0 / 1.000.000	EUR/GBP Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	GBP	Bloomberg L.P.	100	0,9184	0,9092	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:GBP-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: GBPLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURGBP=
PR0DGC, DE000PR0DGC8 / 1.000.000	EUR/GBP Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	GBP	Bloomberg L.P.	100	0,9134	0,9043	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:GBP-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: GBPLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURGBP=
PR0DGD, DE000PR0DGD6 / 1.000.000	EUR/GBP Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	GBP	Bloomberg L.P.	100	0,9084	0,8993	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:GBP-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: GBPLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURGBP=
PR0DGE, DE000PR0DGE4 / 1.000.000	EUR/GBP Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	GBP	Bloomberg L.P.	100	0,9034	0,8944	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:GBP-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: GBPLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURGBP=
PR0DGF, DE000PR0DGF1 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	106,3364	105,2730	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Briefkurs JPY=
PR0DGG, DE000PR0DGG9 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	105,8364	104,7780	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Briefkurs JPY=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DGH, DE000PR0DGH7 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	105,3364	104,2830	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Briefkurs JPY=
PR0DGJ, DE000PR0DGJ3 / 1.000.000	USD/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	104,8364	103,7880	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:USD-LIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: USDLIBOR1 M=	Briefkurs JPY=
PR0DGK, DE000PR0DGK1 / 1.000.000	EUR/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	117,1486	115,9771	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURJPY=
PR0DGL, DE000PR0DGL9 / 1.000.000	EUR/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	116,6486	115,4821	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURJPY=
PR0DGM, DE000PR0DGM7 / 1.000.000	EUR/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	116,1486	114,9871	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURJPY=
PR0DGN, DE000PR0DGN5 / 1.000.000	EUR/JPY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	JPY	Bloomberg L.P.	100	115,6486	114,4921	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:JPY-LIBOR 1M Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: JPYLIBOR1 M= Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURJPY=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DGP, DE000PR0DGP0 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,7186	3,6814	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURTRY=
PR0DGQ, DE000PR0DGQ8 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,6886	3,6517	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURTRY=
PR0DGR, DE000PR0DGR6 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,6586	3,6220	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURTRY=
PR0DGS, DE000PR0DGS4 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,6286	3,5923	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURTRY=
PR0DGT, DE000PR0DGT2 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fx- fixings	Short	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,5986	3,5626	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURTRY=

WKN und ISIN der Optionsscheine / Volumen	Basiswert* (Wechselkurspaar)	Options-Typ	Referenzwährung*	Referenzstelle*	Bezugsverhältnis*	Anfänglicher Basispreis* in Referenzwährung	Anfängliche Stop Loss Schwelle* in Referenzwährung	Stop Loss Schwellen Anpassungssatz* in Prozent	Anfänglicher Zinsanpassungssatz* / Zinsanpassungssatz Bandbreite und Abweichung*		Referenzzinssatz* 1 mit Reutersseite und Referenzzinssatz 2 mit Reutersseite	Beobachtungskurs* / Reutersseite
PR0DGU, DE000PR0DGU0 / 1.000.000	EUR/TRY Wechselkurs www.bloomberg.com/ markets/currencies/fixings	Short	TRY	Bloomberg L.P.	100	3,5686	3,5329	99,0000	2,50%	100% (+/- 50 Prozentpunkte)	Zinssatz 1:TRLIBOR 1M (Briefkurs) Zinssatz 2:EURIBOR 1M Reutersseite 1: TRLIBOR01 Reutersseite 2: EURIBOR1 M=	Briefkurs EURTRY=

\* Zur Klarstellung gelten alle Angaben vorbehaltlich der §§ 3 und 4

EURIBOR = Euro Interbank Offered Rate

LIBOR = London Interbank Offered Rate

TRLIBOR = Turkish Lira Interbank Offered Rate

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

### Ausübung der Optionsrechte

- (1) Die Optionsscheine gelten als automatisch ausgeübt sobald ein Stop Loss Ereignis eintritt.
- (2)
- (a) Optionsrechte können nur für mindestens 1.000 Optionsscheine oder ein ganzzahliges Vielfaches davon ("**Mindestzahl**") ausgeübt werden. Der Optionsscheininhaber muss spätestens am zweiten Bankgeschäftstag vor dem Ausübungstag bis 10:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main):
    - (i) in schriftlicher Form mit allen im nachstehenden Absatz (2)(b) geforderten Angaben eine Erklärung gemäß Absatz (2)(b) ("**Ausübungserklärung**") bei der Zahlstelle gemäß § 8 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) (BNP PARIBAS Securities Services, Zweigniederlassung Frankfurt am Main, Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt am Main (bei Übermittlung per Telefax unter Nr. +49 (0) 69 15205277) einreichen; und
    - (ii) die Optionsscheine auf das Konto der Zahlstelle bei der CBF, Konto 7259 übertragen.

Die wirksame Ausübung des Optionsrechts durch den Optionsscheininhaber, steht unter der auflösenden Bedingung, dass bis einschließlich der Feststellung des Referenzpreises am Ausübungstag ein Stop Loss Ereignis eintritt: Das heißt, der Eintritt eines Stop Loss Ereignisses nach Ausübung gemäß diesem § 2 Absatz (2), führt dazu, dass die Wirksamkeit der Ausübung nachträglich entfällt und dass stattdessen § 2 Absatz (1) zur Anwendung kommt.

- (b) Die Ausübungserklärung muss enthalten:
- (i) den Namen und die Anschrift des Ausübenden,
  - (ii) die Art (WKN oder ISIN) und die Anzahl der Optionsscheine, für die das Optionsrecht ausgeübt wird, und
  - (iii) die Angabe eines in der Auszahlungswährung geführten Bankkontos, auf das der Auszahlungsbetrag überwiesen werden soll.

Die Ausübungserklärung ist bindend und unwiderruflich. Sie wird wirksam, wenn die Ausübungserklärung zugegangen ist und die Optionsscheine fristgerecht bei der Zahlstelle eingegangen sind. Werden die Optionsscheine, auf die sich die Ausübungserklärung bezieht, nicht oder nicht rechtzeitig an die Zahlstelle nach Maßgabe des obenstehenden Absatzes (2)(a) geliefert, so ist die Ausübungserklärung nichtig. Als Bewertungstag i.S.d. § 1 gilt dabei der Bankgeschäftstag, an dem erstmals bis einschließlich 10:00 Uhr vormittags (Ortszeit Frankfurt am Main) die vorgenannten Ausübungsvoraussetzungen für die ausgeübten Optionsrechte erfüllt sind.

Werden abweichend von Absatz (2)(a) Optionsrechte nicht im Umfang der Mindestzahl oder zu einem Vielfachen der Mindestzahl ausgeübt, gilt die Ausübung nur für die nächst kleinere Zahl von Optionsscheinen, die durch die Mindestzahl ganzzahlig ohne Rest teilbar ist. Das gilt entsprechend, sofern die Anzahl der in der Ausübungserklärung genannten Optionsscheine von der Anzahl der an die Zahlstelle übertragenen Optionsscheine abweicht. Die gelieferten überzähligen Optionsscheine werden dem Optionsscheininhaber in beiden Fällen auf dessen Kosten und Risiko zurückübertragen.

- (3) Die Emittentin ist berechtigt zum letzten Bankgeschäftstag eines jeden Monats, erstmals zum 30. November 2016 ("**Kündigungstermin**") die Optionsscheine insgesamt, jedoch nicht teilweise ordentlich zu kündigen. Die Kündigung durch die Emittentin ist spätestens am zweiten Bankgeschäftstag vor dem Kündigungstermin gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt zu machen.



Der Bewertungstag ist in diesem Fall der Kündigungstermin mit der Maßgabe, dass der für den Kündigungstermin maßgebliche Zeitpunkt der ist, zu dem der betreffende Referenzpreis (vorbehaltlich eines Stop Loss Ereignisses und der außerordentlichen Kündigung gemäß § 3) festgestellt wird. Der den Optionsscheininhabern im Falle der ordentlichen Kündigung zu zahlende Auszahlungsbetrag ermittelt sich dann nach Maßgabe der Vorschriften des § 1 Absatz (2) und Absatz (4) (einschließlich des Verweises auf Absatz (3) und Absatz (5)).

### § 3

#### Anpassungen, außerordentliche Kündigung

- (1) Wird der Basiswert in seiner Funktion als gesetzliches Zahlungsmittel des betroffenen Landes durch eine andere Währung oder eine neue Währung ersetzt oder wird der Basiswert mit einer anderen Währung verschmolzen (jeweils als "**Nachfolge-Basiswert**" bezeichnet), wird die Emittentin, sofern die Optionsscheine nicht nach Absatz (2) gekündigt wurden, gegebenenfalls den Nachfolge-Basiswert anstelle des bisherigen Basiswert einsetzen und die Optionsscheinbedingungen in einer Weise anpassen, dass die Optionsscheininhaber wirtschaftlich soweit wie möglich so gestellt werden, wie sie vor Durchführung der Maßnahme nach diesem Absatz (1) standen. Die Emittentin wird dabei den neuen maßgeblichen Wechselkurs auf der Grundlage derjenigen Anzahl von Einheiten des Nachfolge-Basiswertes ermitteln, die sich aus der Umrechnung der Anzahl von Einheiten des Basiswertes die für die Bestimmung des ursprünglichen Wechselkurses herangezogen wurde, in den Nachfolge-Basiswert ergibt. Die Emittentin wird eine Ersetzung des Basiswertes, den relevanten Wechselkurs und gegebenenfalls seine Veröffentlichung durch dritte Stellen ("**Nachfolge-Referenzstelle**") unverzüglich gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt machen.

Jede in diesen Optionsscheinbedingungen enthaltene Bezugnahme auf den Basiswert bzw. gegebenenfalls auf die Referenzstelle gilt, sofern es der Zusammenhang erlaubt, als Bezugnahme auf den Nachfolge-Basiswert bzw. die Nachfolge-Referenzstelle.

- (2) Die Emittentin ist berechtigt aber nicht verpflichtet, die Optionsscheine in den in Absatz (1) genannten Fällen außerordentlich durch Bekanntmachung gemäß § 9 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zu kündigen. Im Falle einer Kündigung zahlt die Emittentin anstatt der unter den Optionsscheinen ansonsten zu leistenden Zahlungen an jeden Optionsscheininhaber einen Betrag je Optionsschein ("**Kündigungsbetrag**"), der von der Emittentin nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) als angemessener Marktpreis des Optionsscheins 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 Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) an die CBF zur Weiterleitung an die Optionsscheininhaber überweisen. Die Emittentin wird den Kündigungsbetrag gemäß § 7 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) zahlen.

- (3) Berechnungen, Entscheidungen und Feststellungen nach den vorstehenden Absätzen werden durch die Berechnungsstelle (§ 8 in Abschnitt B der Optionsscheinbedingungen (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 Optionsscheinbedingungen (Allgemeine Bedingungen) bekannt gemacht.

## § 4

### 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 Stop Loss Ereignisses aussetzen, oder anstelle des Beobachtungskurses einen von ihr zu bestimmenden Ersatz-Kurs des Basiswerts zur Feststellung eines Stop Loss Ereignisses heranziehen.
- (2) **"Marktstörung"** bedeutet:
- (a) die Nicht-Veröffentlichung des relevanten Wechselkurses auf der relevanten Bildschirmseite und auf der Internetseite der Referenzstelle;
  - (b) die Suspendierung oder wesentliche Einschränkung
    - (i) der Bankgeschäfte in dem Land, in dem der Basiswert gesetzliches Zahlungsmittel oder offizielle Währung ist, oder in einem Land, zu dem der Basiswert nach Ansicht der Emittentin in einer wesentlichen Beziehung steht ("**Relevante Jurisdiktion**" genannt);
    - (ii) des Interbankenhandels für den Umtausch des Basiswertes in die andere Währung auf üblichem und legalem Weg oder der Transferierung einer der beiden für den Basiswert relevanten Währungen innerhalb der Relevanten Jurisdiktion;
    - (iii) des Handels im Hinblick auf den Umtausch des Basiswertes in die andere Währung zu einem Wechselkurs, der nicht schlechter ist als der für inländische Finanzinstitute mit Sitz in der Relevanten Jurisdiktion geltende Kurs;
    - (iv) des Handels in einem Termin- oder Optionskontrakt in Bezug auf den Basiswert an einer Terminbörse;
    - (v) bei der Transferierung einer der beiden für den Basiswert relevanten Währungen von Konten innerhalb der Relevanten Jurisdiktion auf Konten außerhalb der Relevanten Jurisdiktion oder bei einem Transfer zwischen Konten innerhalb der Relevanten Jurisdiktion oder an eine nicht in dieser Relevanten Jurisdiktion ansässigen Person;
    - (vi) der Feststellung des Preises oder des Wertes des maßgeblichen Wechselkurses des Basiswertes durch die Referenzstelle;
    - (vii) der Möglichkeit des Erwerbs, der Übertragung, der Veräußerung, des Haltens oder sonstiger Transaktionen in Bezug auf den Basiswert aufgrund von rechtlichen Vorschriften, die in der Relevanten Jurisdiktion eingeführt werden bzw. deren Einführung verbindlich angekündigt wird;

sofern die Auswirkung einer solchen Suspendierung oder Einschränkung nach billigem Ermessen der Emittentin (§ 315 BGB) wesentlich ist. Eine im Laufe eines Tages eintretende Suspendierung oder Einschränkung im Sinne der oben genannten Ereignisse aufgrund von Preisbewegungen, die bestimmte lokal vorgegebene Grenzen überschreiten, gilt nur dann als Marktstörung, wenn diese Beschränkung bis zum Ende der Handelszeit an dem betreffenden Tag fort dauert.

- (3) In Abweichung von Absatz (1), 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 des Basiswerts entspricht dann dem von der Emittentin bestimmten Kurs. Hierbei fordert die Emittentin an diesem Tag vier von ihr ausgewählte führende Banken in Frankfurt am Main auf, ihr die An- und Verkaufskurse für den Basiswert mitzuteilen. Der für die Ermittlung des maßgeblichen Kurses relevante Kurs ist in diesem Fall das arithmetische Mittel der von diesen vier Banken festgestellten An- und Verkaufskurse. Soweit die Emittentin weniger als die vorgenannten An- und Verkaufskurse erhält, wird sie den für die Ermittlung des maßgeblichen Kurses relevanten Kurs unter Berücksichtigung der an dem betreffenden Tag herrschenden Marktgegebenheiten nach billigem Ermessen (§ 315 BGB) bestimmen.

## Weitere Informationen

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

Die Beantragung der Einbeziehung der Optionsscheine in den Freiverkehr der Frankfurter Börse und der Börse Stuttgart ist beabsichtigt. Die Einbeziehung der Optionsscheine in den Handel ist für den 10. November 2016 geplant.

### **Angebotskonditionen:**

#### **Angebotsfrist**

Vom 10. November 2016 bis zum Ablauf der Gültigkeit des Prospekts

#### **Vertriebsstellen**

Banken und Sparkassen

#### **Berechnungsstelle**

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

#### **Zeichnungsverfahren**

Entfällt

#### **Emissionswährung**

EUR

#### **Emissionstermin**

14. November 2016

#### **Valutatag**

14. November 2016

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

Der anfängliche Ausgabepreis und das Volumen je Optionsschein der einzelnen Serien von Optionsscheinen sind nachfolgender Tabelle zu entnehmen.

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PR0DEK6	2,57	1.000.000
DE000PR0DEL4	2,48	1.000.000
DE000PR0DEM2	2,39	1.000.000
DE000PR0DEN0	2,30	1.000.000
DE000PR0DEP5	2,21	1.000.000
DE000PR0DEQ3	2,12	1.000.000
DE000PR0DER1	2,03	1.000.000
DE000PR0DES9	1,94	1.000.000
DE000PR0DET7	1,85	1.000.000
DE000PR0DEU5	1,76	1.000.000
DE000PR0DEV3	1,67	1.000.000
DE000PR0DEW1	1,58	1.000.000
DE000PR0DEX9	1,49	1.000.000
DE000PR0DEY7	1,40	1.000.000
DE000PR0DEZ4	1,31	1.000.000
DE000PR0DE08	1,22	1.000.000
DE000PR0DE16	1,13	1.000.000
DE000PR0DE24	1,04	1.000.000
DE000PR0DE32	3,24	1.000.000
DE000PR0DE40	1,58	1.000.000
DE000PR0DE57	1,02	1.000.000
DE000PR0DE65	2,58	1.000.000
DE000PR0DE73	2,14	1.000.000
DE000PR0DE81	1,70	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PR0DFQ0	2,89	1.000.000
DE000PR0DFR8	2,80	1.000.000
DE000PR0DFS6	2,71	1.000.000
DE000PR0DFT4	2,62	1.000.000
DE000PR0DFU2	2,53	1.000.000
DE000PR0DFV0	2,44	1.000.000
DE000PR0DFW8	2,35	1.000.000
DE000PR0DFX6	2,26	1.000.000
DE000PR0DFY4	2,17	1.000.000
DE000PR0DFZ1	2,08	1.000.000
DE000PR0DF07	1,99	1.000.000
DE000PR0DF15	1,90	1.000.000
DE000PR0DF23	1,81	1.000.000
DE000PR0DF31	1,72	1.000.000
DE000PR0DF49	1,63	1.000.000
DE000PR0DF56	1,54	1.000.000
DE000PR0DF64	1,45	1.000.000
DE000PR0DF72	1,36	1.000.000
DE000PR0DF80	1,26	1.000.000
DE000PR0DF98	1,17	1.000.000
DE000PR0DGA2	1,08	1.000.000
DE000PR0DGB0	2,98	1.000.000
DE000PR0DGC8	2,42	1.000.000
DE000PR0DGD6	1,86	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PR0DE99	1,27	1.000.000
DE000PR0DFA4	2,00	1.000.000
DE000PR0DFB2	1,56	1.000.000
DE000PR0DFC0	1,12	1.000.000
DE000PR0DFD8	5,29	1.000.000
DE000PR0DFE6	4,45	1.000.000
DE000PR0DFE3	3,60	1.000.000
DE000PR0DFG1	2,75	1.000.000
DE000PR0DFH9	1,90	1.000.000
DE000PR0DFJ5	1,05	1.000.000
DE000PR0DFK3	3,34	1.000.000
DE000PR0DFL1	3,25	1.000.000
DE000PR0DFM9	3,16	1.000.000
DE000PR0DFN7	3,07	1.000.000
DE000PR0DFP2	2,98	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PR0DGE4	1,30	1.000.000
DE000PR0DGF1	2,48	1.000.000
DE000PR0DGG9	2,04	1.000.000
DE000PR0DGH7	1,61	1.000.000
DE000PR0DGJ3	1,17	1.000.000
DE000PR0DGK1	2,50	1.000.000
DE000PR0DGL9	2,06	1.000.000
DE000PR0DGM7	1,63	1.000.000
DE000PR0DGN5	1,19	1.000.000
DE000PR0DGP0	5,47	1.000.000
DE000PR0DGQ8	4,63	1.000.000
DE000PR0DGR6	3,78	1.000.000
DE000PR0DGS4	2,93	1.000.000
DE000PR0DGT2	2,08	1.000.000
DE000PR0DGU0	1,24	1.000.000

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

Bundesrepublik Deutschland und Republik Österreich

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

Entfällt

**Verfahren für die Mitteilung des  
zuge teilten Betrags an die Antragsteller  
und Informationen dazu, ob bereits vor  
Erhalt der entsprechenden Mitteilung  
mit den Wertpapieren gehandelt werden  
darf**

Entfällt

## Emissionsspezifische Zusammenfassung

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

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 Punkts 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 Optionsscheine 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 Optionsscheine 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 Optionsscheine 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 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
		<p>Für den Fall, dass ein Finanzintermediär ein Angebot macht, informiert dieser Finanzintermediär die Anleger zum Zeitpunkt der Angebotsvorlage über die Angebotsbedingungen der Optionsscheine.</p> <p>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.</p>

#### 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	<p>Sitz der Emittentin ist Frankfurt am Main. Die Geschäftsadresse lautet: Europa-Allee 12, 60327 Frankfurt, Bundesrepublik Deutschland.</p> <p>Die BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH ist eine Gesellschaft mit beschränkter Haftung gemäß deutschem Recht.</p>
B.4b	Trends, die sich auf die Emittentin und die Branchen, in denen sie tätig ist, auswirken	<p>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 und das kommende Geschäftsjahr eine voraussichtlich weiter steigende Emissionstätigkeit und ein gleich bleibender Marktanteil bzw. ein Ausbau des Marktanteils der Gesellschaft erwartet.</p> <p>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.</p>
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	<p>Entfällt.</p> <p>Die Emittentin gibt derzeit keine Gewinnprognosen oder -schätzungen ab.</p>
B.10	Beschränkungen im Bestätigungsvermerk	<p>Entfällt.</p> <p>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.</p> <p>Der Jahresabschluss der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH für das am 31. Dezember 2015 endende Geschäftsjahr ist von MAZARS GmbH &amp; Co. KG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Theodor-Stern-Kai 1, 60596 Frankfurt am Main, geprüft und mit einem uneingeschränkten Bestätigungsvermerk versehen worden.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben																														
		<p>Der Zwischenabschluss der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH für das am 30. Juni 2015 endende Halbjahr ist von MAZARS GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Theodor-Stern-Kai 1, 60596 Frankfurt am Main, geprüft und mit einem uneingeschränkten Bestätigungsvermerk versehen worden.</p> <p>Der Zwischenabschluss der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH für das am 30. Juni 2016 endende Halbjahr ist von MAZARS GmbH &amp; Co. KG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, Theodor-Stern-Kai 1, 60596 Frankfurt am Main, geprüft und mit einem uneingeschränkten Bestätigungsvermerk versehen worden.<sup>1</sup></p>																														
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 ("<b>HGB</b>") und den ergänzenden Vorschriften des GmbH-Gesetzes ("<b>GmbHG</b>") 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 folgende Tabelle zeigt ausgewählte Finanzinformationen der Emittentin, die den geprüften Zwischenabschlüssen vom 30. Juni 2015 und 30. Juni 2016 entnommen wurden.</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																														

<sup>1</sup>Durch einen Formwechsel wurde die MAZARS GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft zum 1. September 2015 unter Wahrung der rechtlichen Identität in die MAZARS GmbH & Co. KG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft umgewandelt. Die MAZARS GmbH & Co. KG Wirtschaftsprüfungsgesellschaft führte daher den Prüfungsauftrag der BNP Paribas Emissions- und Handelsgesellschaft mbH durch und erstattete demzufolge den Bericht über die erfolgte Zwischenabschlussprüfung.





Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		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 Optionsscheininhaber bekannt gemacht.</p>

### Abschnitt C - Wertpapiere

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
C.1	Art und Gattung der angebotenen Wertpapiere, ISIN	<p>Die Optionsscheine 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 Optionsscheinen lautet: DE000PR0DEK6, DE000PR0DEL4, DE000PR0DEM2, DE000PR0DEN0, DE000PR0DEP5, DE000PR0DEQ3, DE000PR0DER1, DE000PR0DES9, DE000PR0DET7, DE000PR0DEU5, DE000PR0DEV3, DE000PR0DEW1, DE000PR0DEX9, DE000PR0DEY7, DE000PR0DEZ4, DE000PR0DE08, DE000PR0DE16, DE000PR0DE24, DE000PR0DE32, DE000PR0DE40, DE000PR0DE57, DE000PR0DE65, DE000PR0DE73, DE000PR0DE81, DE000PR0DE99, DE000PR0DFA4, DE000PR0DFB2, DE000PR0DFC0, DE000PR0DFD8, DE000PR0DFE6, DE000PR0DFE3, DE000PR0DFG1, DE000PR0DFH9, DE000PR0DFJ5, DE000PR0DFK3, DE000PR0DFL1, DE000PR0DFM9, DE000PR0DFN7, DE000PR0DFP2, DE000PR0DFQ0, DE000PR0DFR8, DE000PR0DFS6, DE000PR0DFT4, DE000PR0DFU2, DE000PR0DFV0, DE000PR0DFW8, DE000PR0DFX6, DE000PR0DFY4, DE000PR0DFZ1, DE000PR0DF07, DE000PR0DF15, DE000PR0DF23, DE000PR0DF31, DE000PR0DF49, DE000PR0DF56, DE000PR0DF64, DE000PR0DF72, DE000PR0DF80, DE000PR0DF98, DE000PR0DGA2, DE000PR0DGB0, DE000PR0DGC8, DE000PR0DGD6, DE000PR0DGE4, DE000PR0DGF1, DE000PR0DGG9, DE000PR0DGH7, DE000PR0DGJ3, DE000PR0DGK1, DE000PR0DGL9, DE000PR0DGM7, DE000PR0DGN5, DE000PR0DGP0, DE000PR0DGQ8, DE000PR0DGR6, DE000PR0DGS4, DE000PR0DGT2, DE000PR0DGU0.</p> <p>Die unter diesem Basisprospekt angebotenen Optionsscheine sind Wertpapiere, welche nicht verzinst werden. Die Emittentin ist verpflichtet, nach Maßgabe der Optionsscheinbedingungen in Abhängigkeit von der Entwicklung des jeweils</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		zugrundeliegenden Basiswertes dem Optionsscheininhaber am Fälligkeitstag einen Auszahlungsbetrag zu zahlen.
C.2	Währung	Die Optionsscheine werden in: EUR begeben und ausgezahlt.
C.5	Beschränkungen für die freie Übertragbarkeit	Entfällt.  Die Optionsscheine 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 Optionsscheinen verbundene Rechte</u></p> <p>Die Optionsscheine werden nicht verzinst.</p> <p>Durch die Optionsscheine erhält der Optionsscheininhaber bei Ausübung einen Anspruch auf Erhalt eines Auszahlungsbetrages, wie unter C.18 beschrieben.</p> <p><u>Rückzahlung</u></p> <p>Die Optionsscheine können nur für mindestens 1.000 Optionsscheine ("Mindestzahl") ausgeübt werden.</p> <p>Der Optionsscheininhaber kann die Ausübung der Optionsrechte spätestens zum zweiten Bankgeschäftstag vor dem Ausübungstag aktiv erklären.</p> <p>Die Optionsscheine gelten automatisch als ausgeübt, sobald ein Stop Loss Ereignis eintritt.</p> <p>Der Optionsscheininhaber ist berechtigt, die Zahlung des Auszahlungsbetrags am Fälligkeitstag von der Emittentin zu verlangen.</p> <p><u>Vorzeitige Rückzahlung</u></p> <p>Die Emittentin ist berechtigt, die Optionsscheine ab einem zuvor festgesetzten Zeitpunkt ordentlich zu kündigen. Mit der ordentlichen Kündigung durch die Emittentin, ist der Optionsscheininhaber berechtigt, von der Emittentin die Zahlung des Auszahlungsbetrags am Fälligkeitstag zu verlangen.</p> <p>Die Emittentin kann berechtigt sein, bei Vorliegen eines Anpassungsereignisses in Bezug auf den Basiswert, das Optionsrecht in Übereinstimmung mit den Optionsscheinbedingungen anzupassen oder die Optionsscheine 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 den Optionsschein gezahlten Kaufpreis liegen und bis auf Null (0) sinken (Totalverlust des eingesetzten Kapitals).</p> <p><u>Rangordnung</u></p> <p>Die Optionsscheine begründen unmittelbare und nicht nachrangige Verbindlichkeiten der Emittentin, für die die Emittentin keine Sicherheiten bestellt hat. Die Optionsscheine 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 Rechte</u></p> <p>Die Emittentin ist unter bestimmten Voraussetzungen zur Anpassung der Optionsscheinbedingungen berechtigt. Darüber hinaus kann die Emittentin berechtigt sein, bei Vorliegen eines Anpassungsereignisses in Bezug auf den Basiswert, die</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		Optionsscheine außerordentlich zu kündigen. Im Falle einer solchen außerordentlichen Kündigung zahlt die Emittentin den Kündigungsbetrag innerhalb von vier Bankgeschäftstagen nach der Bekanntmachung der Kündigung.
C.11	Zulassung der Wertpapiere zum Handel an einem geregelten Markt oder anderen gleichwertigen Märkten	Entfällt. Die Optionsscheine werden nicht an einem geregelten Markt notiert.  Zudem ist geplant, die Optionsscheine in den Freiverkehr an der Frankfurter Börse und der Börse Stuttgart einzuführen.
C.15	Beeinflussung des Anlagewertes durch den Wert des Basisinstruments	Mit den vorliegenden MINI Future <b>Long</b> Optionsscheinen 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 Optionsscheine, wenn der Referenzpreis auf oder unter den Maßgeblichen Basispreis fällt.  Mit den vorliegenden MINI Future <b>Short</b> Optionsscheinen kann der Anleger unter Umständen überproportional an der negativen Wertentwicklung des Basiswertes partizipieren. Der Anleger nimmt jedoch auch überproportional an der positiven Wertentwicklung des Basiswertes teil und trägt das Risiko eines wertlosen Verfalls des Optionsscheines, wenn der Basiswert im Hinblick auf den Bewertungstag auf oder über den Maßgeblichen Basispreis steigt.  Erreicht der Beobachtungskurs die Stop Loss Schwelle, endet die Laufzeit der MINI Future Optionsscheine automatisch. Der gegebenenfalls auszuzahlende Betrag nach einem solchen Stop Loss Ereignis bestimmt sich unter Bezugnahme auf den Wert des Basiswertes, unter Berücksichtigung des Bezugsverhältnisses.

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
C.16	Verfalltag oder Fälligkeitstermin der derivativen Wertpapiere/ Ausübungstermin oder letzter Referenztermin	Die Optionsscheine haben keinen festen Fälligkeitstag. Der Fälligkeitstag liegt vier Bankgeschäftstage nach dem Bewertungstag.  Vorbehaltlich etwaiger Anpassungs- und Störungsregeln, ist der Bewertungstag der zeitlich frühere der folgenden Tage: der Ausübungstag, der Tag, an dem das Stop Loss Ereignis eintritt bzw. spätestens der Tag an dem der Stop Loss Referenzstand ermittelt wird und im Falle einer ordentlichen Kündigung der Optionsscheine durch die Emittentin, der Kündigungstermin.  Ausübungstag und Kündigungstermin sind jeweils der letzte Bankgeschäftstag eines Monats, beginnend mit dem 30. November 2016.  <u>Ausübungstermin:</u>  Der Optionsscheininhaber kann die Ausübung der Optionsrechte spätestens zum zweiten Bankgeschäftstag vor dem Ausübungstag aktiv erklären.  Die Optionsscheine gelten automatisch als ausgeübt, sobald ein Stop Loss Ereignis eintritt.
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 Optionsscheininhaber gezahlt. Die Emittentin wird durch Leistung der Zahlung an die CBF oder zu deren Gunsten von ihrer Zahlungspflicht befreit.
C.18	Ertragsmodalitäten bei derivativen Wertpapieren	Die Zahlung des Auszahlungsbetrages in der Auszahlungswährung pro Optionsschein erfolgt spätestens am Fälligkeitstag an den Optionsscheininhaber.

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p>Der Auszahlungsbetrag entspricht bei MINI Future <b>Long</b> Optionsscheinen:</p> <p>(a) wenn der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Stop Loss Schwelle <b>nicht</b> erreicht oder unterschritten hat, der Differenz aus Referenzpreis und Maßgeblichem Basispreis, multipliziert mit dem Bezugsverhältnis;</p> <p>(b) wenn der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Stop Loss Schwelle erreicht oder unterschritten hat, der Differenz aus Stop Loss Referenzstand und Maßgeblichem Basispreis, multipliziert mit dem Bezugsverhältnis.</p> <p>Der Auszahlungsbetrag entspricht bei MINI Future <b>Short</b> Optionsscheinen:</p> <p>(a) wenn, der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Stop Loss Schwelle <b>nicht</b> erreicht oder überschritten hat, der Differenz aus Maßgeblichem Basispreis und Referenzpreis, multipliziert mit dem Bezugsverhältnis;</p> <p>(b) wenn der Beobachtungskurs während des Beobachtungszeitraums die Stop Loss Schwelle erreicht oder überschritten hat, der Differenz aus Maßgeblichem Basispreis und Stop Loss Referenzstand, multipliziert mit dem Bezugsverhältnis.</p> <p>Wenn der jeweils ermittelte Betrag Null oder ein negativer Wert ist, entspricht der Auszahlungsbetrag lediglich dem Mindestbetrag.</p> <p>Gegebenenfalls erfolgt eine Umrechnung des jeweiligen Betrages von der Referenzwährung des Basiswerts in die Auszahlungswährung.</p> <p>Im Falle einer außerordentlichen Kündigung der Optionsscheine durch die Emittentin, entspricht der von der Emittentin an die Optionsscheininhaber zu zahlende Kündigungsbetrag je Optionsschein einem von der Emittentin nach billigem Ermessen als angemessen bestimmter Marktpreis unmittelbar vor dem zur Kündigung berechtigenden Ereignis.</p> <p>Im Falle einer ordentlichen Kündigung der Optionsscheine durch die Emittentin, entspricht der dem Optionsscheininhaber zu zahlende Betrag dem Auszahlungsbetrag am Kündigungstermin.</p>
C.19	Ausübungspreis / oder endgültiger Referenzpreis des Basiswertes	<p>Der endgültige Referenzpreis (welcher dem in der Verordnung genannten Ausübungspreis entspricht) eines jeden Optionsscheines ist der jeweils festgestellte Preis bzw. Kurs des Basiswerts am Bewertungstag. Die Optionsscheine 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 der offizielle Wechselkurs EUR/Fremdwährung bzw. Fremdwährung 1/Fremdwährung 2 -Wechselkurs (mit Fremdwährung wird jede Währung bezeichnet, die nicht EUR ist) - wie in nachfolgender Tabelle aufgeführt - festgestellte und veröffentlichte Kurs des Basiswerts.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben		
		Basiswert („Wechselkurspaar“)	Referenzpreis	Referenzstelle
		EUR/Fremdwährung	Für die Wechselkurspaare EUR/Fremdwährung ist jeweils der von der Referenzstelle gegenwärtig um 14:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) festgestellte und auf der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle aufgeführten Internetseite veröffentlichte Kurs des Basiswerts.	Bloomberg L.P.
		Fremdwährung 1/ Fremdwährung 2	Für die Wechselkurspaare Fremdwährung 1/ Fremdwährung 2 wird der Referenzpreis durch die Berechnungsstelle auf Grundlage der offiziellen Wechselkurse, die für EUR/Fremdwährung 1 und EUR/Fremdwährung 2 von der Referenzstelle am Bewertungstag festgestellt werden, ermittelt, sofern die Referenzstelle regelmäßig keinen Wechselkurs für Fremdwährung1/Fremdwährung 2 feststellt und veröffentlicht. Die Berechnung erfolgt, indem der Wechselkurs für EUR/Fremdwährung 2 durch den Wechselkurs für EUR/Fremdwährung 1 dividiert wird.  <b>Wechselkurs EUR/Fremdwährung 2</b> <b>Wechselkurs EUR/Fremdwährung 1</b>  Sofern die Referenzstelle regelmäßig einen Wechselkurs für Fremdwährung1/Fremdwährung 2 feststellt und veröffentlicht, ist der Referenzpreis jeweils der von der Referenzstelle gegenwärtig um 14:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) festgestellte und auf der in der am Ende des § 1 stehenden Tabelle aufgeführten Internetseite veröffentlichte Kurs des Basiswerts.	Bloomberg L.P.
C.20	Art des Basiswertes/ Ort, an dem Informationen über den Basiswert erhältlich sind	Währungen.  Der jeweilige Basiswert und die entsprechende Internetseite auf der Informationen über den Basiswert zum Emissionstermin jeder einzelnen Serie von Optionsscheinen erhältlich sind:		

Basiswert	Internetseite
EUR/USD Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/CHF Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/GBP Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
USD/JPY Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/JPY Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>
EUR/TRY Wechselkurs	<a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		Der jeweils aktuelle Wechselkurs ("Bloomberg BFIX rate") basierend auf der gegenwärtig um 14:00 Uhr (Ortszeit Frankfurt am Main) stattfindenden Preisfeststellung kann unter <a href="http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings">http://www.bloomberg.com/markets/currencies/fx-fixings</a> abgerufen werden.  Die auf den Internetseiten erhältlichen Informationen stellen Angaben Dritter dar. Die Emittentin hat diese Informationen keiner inhaltlichen Überprüfung unterzogen.

## 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 Wertpapierinhaber 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. 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 Optionsscheinen nachzukommen, nachteilig beeinflussen können. 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.</li> <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 effektive Umsetzung der Geschäftsstrategien 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> <li>- 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 Optionsscheine auswirken.</li> </ul> <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> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 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,</li> </ul>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p>zahlen. Solche Gebühren werden gegebenenfalls bei der Festsetzung des Preises des Optionsscheines 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 Optionsscheininhabern 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 Optionsscheininhaber 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 Optionsscheine 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 Optionsscheinen eigen sind.</p> <p><u>Basiswert</u></p> <p>Der Optionsscheininhaber trägt das Verlustrisiko im Falle einer ungünstigen Kursentwicklung des zugrundeliegenden Basiswerts. Geschäfte, mit denen Verlustrisiken aus den Optionsscheinen ausgeschlossen oder eingeschränkt werden sollen (Absicherungsgeschäfte), können möglicherweise nicht oder nur zu einem verlustbringenden Preis getätigt werden.</p> <p>Die Optionsscheine verbrieften weder einen Anspruch auf Zinszahlung noch auf Zahlung von Dividenden, Ausschüttungen oder ähnlichen Beträgen und werfen keinen laufenden Ertrag ab. Mögliche Wertverluste der Optionsscheine können daher nicht durch andere laufende Erträge der Optionsscheine kompensiert werden.</p> <p>Kursänderungen des Basiswerts (oder auch schon das Ausbleiben einer erwarteten Kursänderung) können aufgrund des Hebeleffektes den Wert der Optionsscheine sogar überproportional bis hin zur Wertlosigkeit mindern. Es besteht dann das Risiko eines Verlusts, der dem gesamten für die Optionsscheine gezahlten Kaufpreis entsprechen kann, einschließlich der aufgewendeten Transaktionskosten.</p> <p>Für den Fall, dass kein Sekundärmarkt für die Optionsscheine zustande kommt, kann die dann fehlende Liquidität im Handel der Optionsscheine unter Umständen zu einem Verlust, bis hin zum Totalverlust führen.</p> <p><u>Risiken im Zusammenhang mit einer unbeschränkten Laufzeit</u></p> <p>Die Optionsscheine haben keinen festgelegten Fälligkeitstag und dementsprechend keine festgelegte Laufzeit.</p> <p>Das in den Optionsscheinen verbriefte Optionsrecht der Optionsscheininhaber muss dementsprechend durch den jeweiligen Optionsscheininhaber in Übereinstimmung mit dem in den Optionsscheinbedingungen festgelegten Ausübungsverfahren zu einem bestimmten Ausübungstermin ausgeübt werden, um das Optionsrecht geltend zu machen. Zwar hat der Optionsscheininhaber im Fall einer Ausübung der Optionsscheine durch den Optionsscheininhaber damit das Recht, die Wertpapiere zu bestimmten Ausübungsterminen auszuüben, jedoch können diese Termine ungünstig für den Optionsscheininhaber sein. Der Optionsscheininhaber muss selbst entscheiden, ob und inwieweit eine Ausübung des Optionsscheins für ihn von Nachteil ist oder nicht.</p> <p>Zudem ist die Emittentin in Übereinstimmung mit den Optionsscheinbedingungen berechtigt, die Optionsscheine zu einem Ordentlichen Kündigungstermin ordentlich zu</p>



Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p>kündigen. Im Fall einer Kündigung der Wertpapiere durch die Emittentin hat der Optionsscheininhaber keinen Einfluss auf den maßgeblichen Ordentlichen Kündigungstermin, der ungünstig für ihn sein kann.</p> <p>Sowohl im Fall einer ordentlichen Kündigung der Optionsscheine durch die Emittentin als auch im Fall einer Ausübung der Optionsscheine durch den Optionsscheininhaber selbst, trägt der Optionsscheininhaber das Wiederanlagerisiko, denn der durch die Emittentin gegebenenfalls ausgezahlte Betrag kann möglicherweise nur zu ungünstigeren Marktkonditionen als denen, die beim Erwerb des gekündigten bzw. ausgeübten Optionsscheins vorlagen, wiederangelegt werden. Der Optionsscheininhaber trägt das Risiko, dass seine Erwartungen auf einen Wertzuwachs durch eine alternative Wertanlage möglicherweise nicht erfüllt werden.</p> <p><u>Risiken im Zusammenhang mit einer Mindestzahl</u></p> <p>Die Endgültigen Bedingungen der Optionsscheine sehen zudem vor, dass das Ausübungsrecht nur für eine bestimmte Anzahl der Optionsscheine ausgeübt werden kann, die sog. Mindestzahl. Optionsscheininhaber, die nicht über die erforderliche Mindestzahl an Optionsscheinen verfügen, müssen somit entweder ihre Optionsscheine verkaufen oder zusätzliche Optionsscheine kaufen (wobei dafür jeweils Transaktionskosten anfallen). Eine Veräußerung der Optionsscheine setzt jedoch voraus, dass sich Marktteilnehmer finden, die zum Ankauf der Optionsscheine zu einem entsprechenden Preis bereit sind. Finden sich keine solchen kaufbereiten Marktteilnehmer, kann der Wert der Optionsscheine nicht realisiert werden.</p> <p>Liegen die in den Optionsscheinbedingungen beschriebenen Voraussetzungen einer Ausübung nicht fristgerecht zu dem jeweiligen Ausübungstermin vor, ist die Ausübungserklärung nichtig und eine erneute Ausübung kann erst wieder zu dem nächsten in den Optionsscheinbedingungen der Optionsscheine vorgesehenen Ausübungstermin erfolgen.</p> <p>Aufgrund einer zeitlichen Verzögerung zwischen dem Zeitpunkt der Ausübung der Optionsrechte und der Festlegung des aufgrund der Ausübung zu zahlenden Betrages, kann es zu einer Verringerung der Rendite der Optionsscheine kommen.</p> <p>Auch bei wirksamer Ausübung besteht ein Totalverlustrisiko.</p> <p><u>Vorzeitige Beendigung</u></p> <p>Im Falle einer in den Optionsscheinbedingungen vorgesehenen außerordentlichen Kündigung der Optionsscheine durch die Emittentin zahlt die Emittentin an jeden Optionsscheininhaber einen Betrag je Optionsschein ("<b>Kündigungsbetrag</b>"), der als angemessener Marktpreis des Optionsscheines unmittelbar vor dem zur Kündigung berechtigenden Ereignis festgelegt wird. Dabei wird der angemessene Marktpreis des Optionsscheines gemäß den Optionsscheinbedingungen 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 Optionsscheines von einem durch einen Dritten festgelegten Marktpreis des Basiswerts 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 Optionsscheininhaber ist einem Wechselkursrisiko ausgesetzt.</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p>Im Falle einer in den Optionsscheinbedingungen vorgesehenen Quanto Umrechnung, erfolgt eine Umrechnung in die Auszahlungswährung ohne Bezugnahme auf den Wechselkurs zwischen der Währung des Basiswerts und der Auszahlungswährung. Obwohl kein Umrechnungsrisiko besteht, kann der relative Zinsunterschied zwischen dem aktuellen Zinssatz in Bezug auf die Währung des Basiswerts und dem aktuellen Zinssatz in Bezug auf die Auszahlungswährung den Kurs der vorliegenden Wertpapiere negativ beeinflussen.</p> <p><i>Abhängigkeit vom Basiswert</i></p> <p>Liegt der Referenzpreis bei MINI Future <b>Long</b> Optionsscheinen auf oder unter dem Maßgeblichen Basispreis, erfolgt lediglich die Zahlung eines Mindestbetrags an den Optionsscheininhaber.</p> <p>Übersteigt der Referenzpreis den Maßgeblichen Basispreis, entsteht dem Optionsscheininhaber dann ein Verlust, wenn der Auszahlungsbetrag geringer ist als der von dem Optionsscheininhaber entrichtete Kaufpreis.</p> <p>Liegt der Referenzpreis bei MINI Future <b>Short</b> Optionsscheinen auf oder über dem Maßgeblichen Basispreis, erfolgt lediglich die Zahlung eines Mindestbetrags an den Optionsscheininhaber.</p> <p>Unterschreitet der Referenzpreis den Maßgeblichen Basispreis, entsteht dem Optionsscheininhaber dann ein Verlust, wenn der Auszahlungsbetrag geringer ist als der von dem Optionsscheininhaber entrichtete Kaufpreis.</p> <p>Eine erklärte ordentliche Kündigung wird gegenstandslos, wenn bis einschließlich zum relevanten Kündigungstermin ein Stop Loss Ereignis eintritt.</p> <p>Im Fall von MINI Future <b>Long</b> Optionsscheinen kann der Auszahlungsbetrag Null betragen, wenn der Stop Loss Referenzstand kleiner oder gleich dem Maßgeblichen Basispreis ist.</p> <p>Im Fall von MINI Future <b>Short</b> Optionsscheinen kann der Auszahlungsbetrag Null betragen, wenn der Stop Loss Referenzstand größer oder gleich dem Maßgeblichen Basispreis ist.</p> <p>Es ist zu beachten, dass bei Eintritt eines Stop Loss Ereignisses der zu zahlende Betrag dem im Falle eines Stop Loss Ereignisses maßgeblichen Auszahlungsbetrag entspricht; der Bewertungstag ist in diesem Fall der Tag, an dem das Stop Loss Ereignis eingetreten ist, spätestens jedoch der Tag der Feststellung des Stop Loss Referenzstands, und der zu zahlende Auszahlungsbetrag kann lediglich einem Mindestbetrag pro Optionsschein entsprechen.</p> <p>Soweit kein Stop Loss Ereignis vorliegt, wird zu keinem Zeitpunkt während der Laufzeit der Optionsscheine die Zahlung eines Auszahlungsbetrages automatisch fällig. Eine Zahlung wird nur fällig, wenn der Optionsscheininhaber sein Optionsrecht ausübt oder die Emittentin kündigt.</p> <p>Der Eintritt eines Stop Loss Ereignisses führt dazu, dass eine etwaige vorherige Ausübung durch den Optionsscheininhaber aufgrund der eingetretenen auflösenden Bedingung nachträglich ihre Wirksamkeit verliert und die betreffenden Optionsscheine zu einem deutlich reduzierten Auszahlungsbetrag automatisch ausgeübt werden (dieser Betrag kann lediglich einem Mindestbetrag pro Optionsschein entsprechen).</p> <p>Im Übrigen bestehen unter anderem noch folgende Risiken, die sich negativ auf den Wert des Optionsscheines und entsprechend nachteilig auf den Ertrag des Anlegers bis hin zum Totalverlust auswirken können:</p>

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<ul style="list-style-type: none"> <li>• Die Investition in die Optionsscheine stellt keine Direktinvestition in den Basiswert dar. Kursänderungen des Basiswerts (oder das Ausbleiben von erwarteten Kursänderungen) können eine überproportionale negative Wertveränderung der Optionsscheine zur Folge haben.</li> <li>• Provisionen und andere Transaktionskosten führen zu Kostenbelastungen des Optionsscheininhabers, die zu einem Verlust unter den Optionsscheinen führen können.</li> <li>• Aufgrund der Kündigungsmöglichkeit der Emittentin können Absicherungsgeschäfte gegebenenfalls nicht oder nur mit verlustbringendem Preis abgeschlossen werden.</li> <li>• Es besteht ein Wiederanlagerisiko des Optionsscheininhabers im Fall einer ordentlichen bzw. einer außerordentlichen Kündigung der Emittentin.</li> <li>• Es besteht das Risiko einer negativen Wertbeeinflussung der Optionsscheine durch Marktstörungen.</li> <li>• Weiterhin ist zu beachten, dass eine Marktstörung gegebenenfalls die Zahlung des jeweils geschuldeten Betrags an den Anleger verzögern kann.</li> <li>• Jedes Anpassungsereignis stellt ein Risiko der Anpassung oder der Beendigung der Laufzeit der Optionsscheine dar, welches negative Auswirkungen auf den Wert der Optionsscheine haben kann.</li> <li>• Die Entwicklung des Basiswertes und der Optionsscheine hängt von marktpreisbestimmenden Faktoren ab.</li> <li>• Es besteht für den Optionsscheininhaber das Risiko, dass die Zeichnung, der Erwerb, das Halten oder die Veräußerung der Optionsscheine Gegenstand einer Besteuerung mit einer Finanztransaktionsteuer werden könnte.</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 Optionsscheine werden in globaler Form von Clearstream verwahrt, sodass ein Einbehalt auf Zahlungen an Clearstream unwahrscheinlich ist. FATCA könnte aber auf die nachfolgende Zahlungskette anzuwenden sein. Dementsprechend könnten die Anleger möglicherweise geringere Zinsen oder Kapitalbeträge als erwartet erhalten.</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> <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 Optionsscheine und im Extremfall zu einem Totalverlust des von den Optionsscheininhabern 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 Optionsscheinen verwenden.
E.3	Angebotskonditionen	Die Optionsscheine werden von der BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C., Paris, Frankreich ab dem 10. November 2016 interessierten Anlegern angeboten. Das öffentliche Angebot endet mit Ablauf der Gültigkeit des Prospekts.  Der anfängliche Ausgabepreis und das Gesamtvolumen je Serie von Optionsscheinen ist:

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen	ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PR0DEK6	2,57	1.000.000	DE000PR0DFQ0	2,89	1.000.000
DE000PR0DEL4	2,48	1.000.000	DE000PR0DFR8	2,80	1.000.000
DE000PR0DEM2	2,39	1.000.000	DE000PR0DFS6	2,71	1.000.000
DE000PR0DEN0	2,30	1.000.000	DE000PR0DFT4	2,62	1.000.000
DE000PR0DEP5	2,21	1.000.000	DE000PR0DFU2	2,53	1.000.000
DE000PR0DEQ3	2,12	1.000.000	DE000PR0DFV0	2,44	1.000.000
DE000PR0DER1	2,03	1.000.000	DE000PR0DFW8	2,35	1.000.000
DE000PR0DES9	1,94	1.000.000	DE000PR0DFX6	2,26	1.000.000
DE000PR0DET7	1,85	1.000.000	DE000PR0DFY4	2,17	1.000.000
DE000PR0DEU5	1,76	1.000.000	DE000PR0DFZ1	2,08	1.000.000
DE000PR0DEV3	1,67	1.000.000	DE000PR0DF07	1,99	1.000.000
DE000PR0DEW1	1,58	1.000.000	DE000PR0DF15	1,90	1.000.000
DE000PR0DEX9	1,49	1.000.000	DE000PR0DF23	1,81	1.000.000
DE000PR0DEY7	1,40	1.000.000	DE000PR0DF31	1,72	1.000.000
DE000PR0DEZ4	1,31	1.000.000	DE000PR0DF49	1,63	1.000.000
DE000PR0DE08	1,22	1.000.000	DE000PR0DF56	1,54	1.000.000
DE000PR0DE16	1,13	1.000.000	DE000PR0DF64	1,45	1.000.000
DE000PR0DE24	1,04	1.000.000	DE000PR0DF72	1,36	1.000.000
DE000PR0DE32	3,24	1.000.000	DE000PR0DF80	1,26	1.000.000
DE000PR0DE40	1,58	1.000.000	DE000PR0DF98	1,17	1.000.000
DE000PR0DE57	1,02	1.000.000	DE000PR0DGA2	1,08	1.000.000
DE000PR0DE65	2,58	1.000.000	DE000PR0DGB0	2,98	1.000.000
DE000PR0DE73	2,14	1.000.000	DE000PR0DGC8	2,42	1.000.000
DE000PR0DE81	1,70	1.000.000	DE000PR0DGD6	1,86	1.000.000
DE000PR0DE99	1,27	1.000.000	DE000PR0DGE4	1,30	1.000.000
DE000PR0DFA4	2,00	1.000.000	DE000PR0DGF1	2,48	1.000.000

ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen	ISIN	Anfänglicher Ausgabepreis in EUR	Volumen
DE000PR0DFB2	1,56	1.000.000	DE000PR0DGG9	2,04	1.000.000
DE000PR0DFC0	1,12	1.000.000	DE000PR0DGH7	1,61	1.000.000
DE000PR0DFD8	5,29	1.000.000	DE000PR0DGJ3	1,17	1.000.000
DE000PR0DFE6	4,45	1.000.000	DE000PR0DGK1	2,50	1.000.000
DE000PR0DFF3	3,60	1.000.000	DE000PR0DGL9	2,06	1.000.000
DE000PR0DFG1	2,75	1.000.000	DE000PR0DGM7	1,63	1.000.000
DE000PR0DFH9	1,90	1.000.000	DE000PR0DGN5	1,19	1.000.000
DE000PR0DFJ5	1,05	1.000.000	DE000PR0DGP0	5,47	1.000.000
DE000PR0DFK3	3,34	1.000.000	DE000PR0DGQ8	4,63	1.000.000
DE000PR0DFL1	3,25	1.000.000	DE000PR0DGR6	3,78	1.000.000
DE000PR0DFM9	3,16	1.000.000	DE000PR0DGS4	2,93	1.000.000
DE000PR0DFN7	3,07	1.000.000	DE000PR0DGT2	2,08	1.000.000
DE000PR0DFP2	2,98	1.000.000	DE000PR0DGU0	1,24	1.000.000

Punkt	Beschreibung	Geforderte Angaben
		<p>Die Emittentin behält sich das Recht vor, die Emission der Optionsscheine ohne Angabe von Gründen nicht vorzunehmen.</p> <p>Die Lieferung der Optionsscheine 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 Optionsscheinen 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 Optionsscheinen. 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 Optionsscheine und anderen damit verbundenen Feststellungen und (ii) ihrer Funktion als Anbieterin und Gegenpartei.</p> <p>Zudem kann und wird die BNP PARIBAS ARBITRAGE S.N.C. in Bezug auf die Optionsscheine eine andere Funktion als die der Anbieterin, Berechnungsstelle und Gegenpartei ausüben, z.B. als Zahl- und Verwaltungsstelle.</p>
E.7	Schätzung der Ausgaben, die dem Anleger vom Emittenten oder Anbieter in Rechnung gestellt werden	<p>Entfällt.</p> <p>Der Anleger kann die Optionsscheine 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 Optionsscheine 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 Optionsscheine verbundenen Kosten der Emittentin (z.B. Vertriebskosten, Strukturierungskosten und Absicherungskosten, einschließlich einer Ertragsmarge für die Emittentin) enthalten.</p>