

PROHIBITION OF SALES TO UK RETAIL INVESTORS – The Securities are not intended to be offered, sold or otherwise made available to and should not be offered, sold or otherwise made available to any retail investor in the United Kingdom (UK). For these purposes, a retail investor means a person who is one (or more) of: (i) a retail client, as defined in point (8) of Article 2 of Regulation (EU) No 2017/565 as it forms part of domestic law by virtue of the EUWA and regulations made thereunder; (ii) a customer within the meaning of the provisions of the FSMA and any rules or regulations made under the FSMA to implement Directive (EU) 2016/97, where that customer would not qualify as a professional client, as defined in point (8) of Article 2(1) of Regulation (EU) No 600/2014 as it forms part of domestic law by virtue of the EUWA and regulations made thereunder; or (iii) not a qualified investor as defined in Regulation (EU) 2017/1129 as it forms part of domestic law by virtue of the EUWA and regulations made thereunder (the **UK Prospectus Regulation**). Consequently, no key information document required by Regulation (EU) No 1286/2014 as it forms part of domestic law by virtue of the EUWA and regulations made thereunder (the **UK PRIIPs Regulation**) for offering or selling the Securities or otherwise making them available to retail investors in the UK has been prepared and therefore offering or selling the Securities or otherwise making them available to any retail investor in the UK may be unlawful under the UK PRIIPs Regulation.

Final Terms dated 17 June 2024

Citigroup Global Markets Funding Luxembourg S.C.A.

Legal Entity Identifier (LEI): 549300EVRWDWFJUNNP53

Issue of up to 25,000 Units (each Unit being EUR 1,000 in principal amount) of Autocall Notes linked to the EURO STOXX® Utilities Price EUR Index, due July 2028

Guaranteed by Citigroup Global Markets Limited
Under the Citi Global Medium Term Note Programme

Any person making or intending to make an offer of the Securities in any Member State of the EEA may only do so:

- (a) in those Public Offer Jurisdiction(s) mentioned in item 9 of Part B below, provided such person is one of the persons mentioned in item 10 of Part B below and that such offer is made during the Offer Period specified for such purpose therein and that any conditions relevant to the use of the Base Prospectus are complied with; or
- (b) otherwise in circumstances in which no obligation arises for the Issuer or any Dealer to publish a prospectus pursuant to Article 3 of the EU Prospectus Regulation or supplement a prospectus pursuant to Article 23 of the EU Prospectus Regulation, in each case, in relation to such offer.

None of the Issuer, the CGMFL Guarantor and any Dealer has authorised, nor do any of them authorise, the making of any offer of Securities in any other circumstances.

For the purposes hereof, the expression "**EU Prospectus Regulation**" means Regulation (EU) 2017/1129 (as amended).

The Securities and the CGMFL Deed of Guarantee have not been and will not be registered under the United States Securities Act of 1933, as amended (the **Securities Act**) or any state securities law. The Securities and the CGMFL Deed of Guarantee are being offered and sold outside the United States to non-U.S. persons in reliance on Regulation S under the Securities Act (**Regulation S**) and may not be offered or sold within the United States or to, or for the account or benefit of, any U.S. person (as defined in Regulation S). Each purchaser of the Securities or any beneficial interest therein will be deemed to have represented and agreed that it is outside the United States and is not a U.S. person and will not sell, pledge or otherwise transfer the Securities or any beneficial interest therein at any time within the United States or to, or for the account or benefit of, a U.S. person, other than the Issuer or any affiliate thereof. The Securities and the CGMFL Deed of Guarantee do not constitute, and have not been marketed as, contracts of sale of a commodity for future delivery (or options thereon) subject to the United States Commodity Exchange Act, as amended, and trading in the Securities has not been approved by the United

States Commodity Futures Trading Commission under the United States Commodity Exchange Act, as amended. For a description of certain restrictions on offers and sales of Securities, see "*General Information relating to the Programme and the Securities - Subscription and Sale and Transfer and Selling Restrictions*" in the Base Prospectus.

The Securities may not be offered or sold to, or acquired by, any person that is, or whose purchase and holding of the Securities is made on behalf of or with "plan assets" of, an employee benefit plan subject to Title I of the U.S. Employee Retirement Income Security Act of 1974, as amended (**ERISA**), a plan, individual retirement account or other arrangement subject to Section 4975 of the U.S. Internal Revenue Code of 1986, as amended (the **Code**) or an employee benefit plan or other plan or arrangement subject to any laws, rules or regulations substantially similar to Title I of ERISA or Section 4975 of the Code.

PART A – CONTRACTUAL TERMS

The Securities are English Law Securities. A Summary of the Securities is annexed to these Final Terms.

Terms used herein shall be deemed to be defined as such for the purposes of the Conditions set forth under the section entitled "*General Conditions of the Securities*" (including, for the avoidance of doubt, each relevant Schedule) and the Underlying Schedule applicable to each Underlying in the Base Prospectus and the Supplements, which together constitute a base prospectus for the purposes of the EU Prospectus Regulation.

This document constitutes the Final Terms of the Securities described herein for the purposes of Article 8(4) of the EU Prospectus Regulation. This Final Terms must be read in conjunction with the Base Prospectus as so supplemented. Full information on the Issuer, the CGMFL Guarantor and the offer of the Securities is only available on the basis of the combination of this Final Terms and the Base Prospectus as so supplemented up to, and including, the later of the close of the offer period and the date of listing of the Securities.

The Base Prospectus and the Supplements are available for viewing at the offices of the Paying Agents and on the website of the Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com). In addition, this Final Terms and the translation of the Summary into Hungarian are available on the website of the Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com) and the website of the Initial EEA Authorised Offeror(s) (<https://www.otpbank.hu/portal/hu/GlobalMarkets/Maganszemely/StrukturaltBefektetes/Note>).

For the purposes hereof, **Base Prospectus** means the CGMFL Underlying Linked Notes Base Prospectus relating to the Programme dated 15 December 2023, as supplemented by a Supplement (No. 1) dated 30 January 2024 (**Supplement No. 1**), a Supplement (No. 2) dated 13 March 2024 (**Supplement No. 2**), a Supplement (No. 3) dated 30 April 2024 (**Supplement No. 3**) and a Supplement (No. 4) dated 22 May 2024 (**Supplement No. 4** and, together with Supplement No. 1, Supplement No. 2 and Supplement No. 3, the **Supplements**).

- | | | | |
|----|-------|---|--|
| 1. | (i) | Issuer: | Citigroup Global Markets Funding Luxembourg S.C.A. |
| | (ii) | Guarantor: | Citigroup Global Markets Limited |
| 2. | (i) | Type of Security: | Notes |
| | (ii) | Series Number: | CGMFL80176 |
| | (iii) | Tranche Number: | 1 |
| | (iv) | Date on which the Securities will be consolidated and form a single Series: | Not Applicable |
| 3. | | Specified Currency or currencies: | Euro (EUR) |
| 4. | | Aggregate Principal Amount::: | |

- (i) Series: Up to 25,000 Units (each Unit being EUR 1,000 in principal amount of the Securities)
- (ii) Tranche: Up to 25,000 Units (each Unit being EUR 1,000 in principal amount of the Securities)
- The Securities are issued in Units. Accordingly, references herein to Units shall be deemed to be references to EUR 1,000 in principal amount of the Securities and all references in the Conditions to payments and/or deliveries being made in respect of a Security shall be construed to such payments and/or deliveries being made in respect of a Unit
5. Issue Price: EUR 1,000 per Unit
6. (i) Specified Denominations: 1 Unit
- (ii) Calculation Amount: 1 Unit
7. (i) Trade Date: 5 July 2024
- (ii) Issue Date: 12 July 2024
- (iii) Interest Commencement Date: Not Applicable
8. Maturity Date: 12 July 2028
9. Type of Securities: The Securities do not bear or pay any interest
- Mandatory Early Redemption Provisions are applicable as specified in item 14(iii) below
- The Securities are Underlying Linked Securities and the Redemption Amount of the Securities is determined in accordance with item 14(iv) and, as the Underlying Linked Securities Redemption Provisions are applicable, item 14(v) below
- The Securities are Cash Settled Securities
10. Put/Call Options: Not Applicable
11. (i) Status of the Securities: Senior
- (ii) Status of the CGMHI Deed of Guarantee: Not Applicable
- (iii) Status of the CGMFL Deed of Guarantee: Senior

PROVISIONS RELATING TO UNDERLYING LINKED SECURITIES AND EARLY REDEMPTION

12. **Underlying Linked Securities Provisions:** Applicable – the provisions in the Valuation and Settlement Schedule apply (subject as provided in any relevant Underlying Schedule)
- (i) Underlying: Applicable

	(A)	Description of Underlying(s):		EURO STOXX® Utilities Price EUR Index (ISIN: EU0009658582)
	(B)	Classification:		Security Index
	(C)	Electronic Page:		Bloomberg Page: SX6E <Index>
(ii)		Particulars in respect of each Underlying:		Applicable
		Security Index/Indices:		
	(A)	Type of Index:		Multiple Exchange Index
	(B)	Exchange(s):		As defined in paragraph (b) of the definition of "Exchange" in the Security Index Conditions
	(C)	Related Exchange(s):		All Exchanges
	(D)	Single Valuation Time:		Not Applicable
	(E)	Same Day Publication:		Applicable
(iii)		Elections in respect of each type of Underlying:		Applicable
		Security Index/Indices:		
	(A)	Additional Event(s):	Disruption	Increased Cost of Stock Borrow Loss of Stock Borrow
	(B)	Additional Event(s):	Adjustment	Security Index Condition 4: Applicable Early Redemption Option: Applicable Early Redemption Amount: Fair Market Value Deduction of Hedge Costs: Applicable Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable Pro Rata Issuer Cost Reimbursement: Not Applicable Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
	(C)	Security Adjustment Event(s):	Index	Security Index Condition 6(b)(i): Applicable Early Redemption Option: Applicable Early Redemption Amount: Fair Market Value Deduction of Hedge Costs: Applicable

			Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
			Pro Rata Issuer Cost Reimbursement: Not Applicable
			Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(D)	Additional Redemption Event(s):	Early Security Index Condition 5:	Applicable
			Early Redemption Amount: Fair Market Value
			Deduction of Hedge Costs: Applicable
			Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
			Pro Rata Issuer Cost Reimbursement: Not Applicable
			Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(E)	Security Substitution:	Index	Applicable
(iv)	Trade Date:		5 July 2024
(v)	Realisation Disruption:		Not Applicable
(vi)	Hedging Disruption Early Termination Event:		Not Applicable
(vii)	Hedging Disruption:		Applicable
			Early Redemption Option: Applicable
			Early Redemption Amount: Fair Market Value
			Deduction of Hedge Costs: Applicable
			Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
			Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(viii)	Section 871(m) Event:		Applicable
			Early Redemption Option: Applicable
			Early Redemption Amount: Fair Market Value
			Deduction of Hedge Costs: Applicable
			Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable

		Pro Rata Issuer Cost Reimbursement: Not Applicable
		Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(ix)	Early Redemption for Taxation Reasons:	Applicable
		Early Redemption Option: Applicable
		Early Redemption Amount: Fair Market Value
		Deduction of Hedge Costs: Applicable
		Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
		Pro Rata Issuer Cost Reimbursement: Not Applicable
		Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(x)	Change in Law:	Applicable
		Illegality: Applicable
		Material Increased Cost: Applicable
		Early Redemption Option: Applicable
		Early Redemption Amount: Fair Market Value
		Deduction of Hedge Costs: Applicable
		Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
		Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(xi)	Increased Cost of Hedging:	Applicable
		Early Redemption Option: Applicable
		Early Redemption Amount: Fair Market Value
		Deduction of Hedge Costs: Applicable
		Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
		Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(xii)	Early Redemption for Illegality:	Applicable
		Early Redemption Amount: Fair Market Value
		Deduction of Hedge Costs: Applicable

		Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
		Pro Rata Issuer Cost Reimbursement: Not Applicable
		Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(xiii)	Continuance of Securities Provision:	Not Applicable
(xiv)	Early Redemption for Obligor Regulatory Event:	Not Applicable
(xv)	Event of Default:	Early Redemption Amount: Fair Market Value
		Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
		Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
(xvi)	Minimum Return Amount:	Not Applicable

PROVISIONS RELATING TO ANY INTEREST AMOUNT, THE REDEMPTION AMOUNT AND ANY ENTITLEMENT DELIVERABLE

13. **Interest Provisions:** Not Applicable – the Securities do not bear or pay any interest

14. **Redemption Provisions:**

(i)	Issuer Call	Not Applicable
(ii)	Investor Put	Not Applicable
(iii)	Mandatory Early Redemption Provisions	Applicable
	General:	
(A)	Mandatory Early Redemption Strike Level, Specified MER Valuation Date, Specified MER Upper Barrier Event Valuation Date, Lower MER Barrier Level, Upper MER Barrier Level, MER Barrier Level, Specified MER Barrier Observation Date, MER Amount, Upper Mandatory Early Redemption Amount and Lower Mandatory Early Redemption Amount, MERPR, MERPR Call,	See Table below

MERPR Put, MER Date,
 MER Coupon, MER
 Coupon Payment Date (as
 relevant):

- (B) Specified Mandatory Early Redemption Strike Date: For the purpose of determining whether a MER Barrier Event has occurred: 5 July 2024

Underlying(s) relevant to
 Mandatory Early Redemption,
 Mandatory Early Redemption
 Performance Provisions and levels
 of the Mandatory Early
 Redemption Underlying(s)

- (A) Mandatory Early Redemption Underlying: The Underlying specified in item 12 above

- (B) Mandatory Early Redemption Barrier Underlying(s): The Mandatory Early Redemption Underlying

Mandatory Early Redemption Performance Provisions: Not Applicable

Provisions relating to levels of the
 Mandatory Early Redemption
 Underlying(s) Applicable

- (A) Mandatory Early Redemption Initial Level: For the purpose of determining whether a MER Barrier Event has occurred: Closing Level on Mandatory Early Redemption Strike Date

- (B) Mandatory Early Redemption Reference Level: Not Applicable

Provisions relating to a Mandatory
 Early Redemption Barrier Event Applicable

- (A) Mandatory Early Redemption Barrier Event: Applicable – Mandatory Early Redemption Barrier Event European Observation

Provisions relating to a Mandatory
 Early Redemption Upper Barrier
 Event: Not Applicable

Provisions relating to the
 Mandatory Early Redemption
 Amount

- (A) Mandatory Early Redemption Amount due where MER Upper Barrier Percentage is Not Applicable: See MER Amount in Table below

(B) Mandatory Early Redemption Amount due where MER Upper Barrier Percentage is Applicable: Not Applicable

(C) Performance-Linked Mandatory Early Redemption Amount: Not Applicable

(D) Snowball Mandatory Accrual Early Redemption Amount: Not Applicable

Mandatory Early Redemption Underlying Valuation Provisions: Applicable

(A) Valuation (Scheduled Days): Disruption Trading The provisions of Valuation and Settlement Condition 2(c)(i) (*Adjustments to Valuation Dates (Scheduled Trading Days)*) apply

(B) Valuation (Disrupted Days): Disruption Trading The provisions of Valuation and Settlement Condition 2(d)(i) (*Adjustments to Valuation Dates (Disrupted Days and Underlying Closing Levels)*) apply

(C) Valuation Roll: Eight

TABLE

MER Barrier Level (%)	Specified MER Barrier Observation Date	MER Amount	MER Date
	For the purpose of determining whether a MER Barrier Event has occurred:		
greater than (or equal to) 100.00% of the MER Initial Level of the relevant MERBU	7 July 2025	EUR 1,072.50	14 July 2025
greater than (or equal to) 100.00% of the MER Initial Level of the relevant MERBU	6 July 2026	EUR 1,145	13 July 2026
greater than (or equal to) 100.00% of the MER Initial Level of the relevant MERBU	5 July 2027	EUR 1,217.50	12 July 2027

(iv) Redemption Amount: See item (v) below

(v) Underlying Linked Securities Redemption Provisions: Applicable

Dates

- (A) Specified Redemption Barrier Observation Date: For the purpose of determining whether a Redemption Barrier Event has occurred: 5 July 2028
- (B) Specified Final Valuation Date(s): 5 July 2028
- (C) Specified Redemption Strike Date: 5 July 2024

Underlying(s) relevant to redemption, Final Performance provisions and levels of the Redemption Underlying(s)

- (A) Redemption Underlying(s): The Underlying specified in item 12 above
- (B) Redemption Barrier Underlying(s): The Redemption Underlying

Final Performance Provisions: Applicable

- (A) Single Underlying Observation: Applicable for the purpose of determining the Performance-Linked Redemption Amount if a Redemption Barrier Event and a Redemption Lower Barrier Event have occurred

I. Maximum Final Performance Percentage: Not Applicable

II. Minimum Final Performance Percentage: Not Applicable

III. Maximum Final Performance Percentage (Barrier Event): Not Applicable

IV. Minimum Final Performance Percentage (Barrier Event): Not Applicable

V. Maximum Final Performance Percentage (Barrier Event Satisfied): Not Applicable

VI. Minimum Final Performance Percentage (Barrier Event Satisfied): Not Applicable

	VII.	Maximum Final Performance Percentage (Barrier Event Not Satisfied):	Not Applicable
	VIII.	Minimum Final Performance Percentage (Barrier Event Not Satisfied):	Not Applicable
	IX.	Final Performance Adjustment Percentage:	Not Applicable
(B)	Weighted Observation:	Basket	Not Applicable
(C)	Best of Observation:	Basket	Not Applicable
(D)	Worst of Observation:	Basket	Not Applicable
(E)	Outperformance Observation:		Not Applicable
(F)	Arithmetic Underlying Return:	Mean	Not Applicable
(G)	Cliquet:		Not Applicable
(H)	Himalaya Performance – Asian Observation:	Final	Not Applicable
	Provisions relating to levels of the Redemption Underlying(s)		Applicable
(A)	Redemption Level:	Initial	Closing Level on Redemption Strike Date
(B)	Final Reference Level:		Closing Level on Final Valuation Date
(C)	Redemption Level:	Strike	For the purpose of determining the Performance-Linked Redemption Amount if a Redemption Barrier Event and a Redemption Lower Barrier Event have occurred: Redemption Initial Level
	Provisions relating to a Redemption Barrier Event:		Applicable
(A)	Redemption Event:	Barrier	Applicable – Redemption Barrier Event European Observation

- (B) Final Barrier Level: Less than 100.00% of the Redemption Initial Level of the Redemption Barrier Underlying
- Provisions relating to the redemption amount due or entitlement deliverable: Applicable
- Provisions applicable where Redemption Barrier Event is Not Applicable and the Redemption Amount is a Performance-Linked Redemption Amount: Not Applicable
- Provisions applicable where Redemption Barrier Event is Applicable
- (A) Provisions applicable to Physical Delivery: Not Applicable
- (B) Redemption Upper Barrier Event: Not Applicable
- (C) Redemption Amount due where no Redemption Barrier Event has occurred and no Redemption Upper Barrier Event is specified: Applicable – EUR 1,290 per Security
- (D) Redemption Upper Barrier Percentage: Not Applicable
- I. Redemption Upper Amount due where no Redemption Barrier Event has occurred: Not Applicable
- II. Redemption Lower Amount due where no Redemption Barrier Event has occurred: Not Applicable
- (E) Redemption Amount due where a Redemption Barrier Event has occurred and no Redemption Lower Barrier Event is specified: Not Applicable

(F)	Redemption Barrier Event:	Lower	Applicable
			Redemption Lower Barrier Event Underlying Closing Level
			less than
			The Specified Redemption Lower Barrier Event Valuation Date will be 5 July 2028
	Redemption Barrier Underlying(s):	Lower	The Redemption Underlying
	Redemption Barrier Percentage:	Lower	65.00% of the Redemption Initial Level for the Redemption Lower Barrier Underlying
(G)	Redemption Amount due where a Redemption Barrier Event has occurred and a Redemption Lower Barrier Event is specified:		Applicable
	I. Lower Barrier Event Redemption Amount due where a Redemption Barrier Event has occurred:		Applicable – the Performance-Linked Redemption Amount determined in accordance with Put Option Provisions
	II. Non Lower Barrier Event Redemption Amount due where a Redemption Barrier Event has occurred:		Applicable – EUR 1,000 per Security
	Performance-Linked Redemption Amount:		
	Put Option		Applicable if a Redemption Barrier Event and a Redemption Lower Barrier Event occur
	I. Relevant Percentage:		100.00%
	II. Maximum Redemption Amount:	Redemption	Not Applicable
	III. Minimum Redemption Amount:	Redemption	Not Applicable

IV.	Maximum Redemption Amount (Barrier Event Satisfied):	Not Applicable
V.	Minimum Redemption Amount (Barrier Event Satisfied):	Not Applicable
VI.	Maximum Redemption Amount (Barrier Event Not Satisfied):	Not Applicable
VII.	Minimum Redemption Amount (Barrier Event Not Satisfied):	Not Applicable
VIII.	Final Participation Rate (FPR):	Not Applicable
IX.	Redemption Adjustment:	Not Applicable
	Call Option	Not Applicable
	Call Spread - Put Spread Option:	Not Applicable
	Twin Win Option:	Not Applicable
	Market Timer:	Not Applicable
	Put Call Sum:	Not Applicable
	Swaption:	Not Applicable
	Provisions relating to Buy the Dip Securities:	Not Applicable
	Redemption Underlying Valuation Provisions	Applicable
(A)	Valuation Disruption (Scheduled Trading Days):	The provisions of Valuation and Settlement Condition 2(c)(i) (<i>Adjustments to Valuation Dates (Scheduled Trading Days)</i>) apply
(B)	Valuation Disruption (Disrupted Days):	The provisions of Valuation and Settlement Condition 2(d)(i) (<i>Adjustments to Valuation Dates (Disrupted Days and Underlying Closing Levels)</i>) apply
(C)	Valuation Roll:	Eight
	Provisions relating to the Preference Share-Linked Redemption Amount in respect of Preference Share Linked Securities	Not Applicable
	Split Payment Conditions:	Not Applicable
15.	FX Provisions:	Not Applicable

16. **FX Performance:** Not Applicable

PROVISIONS RELATING TO CREDIT LINKED NOTES

17. **Credit Linked Notes:** Not Applicable

PROVISIONS RELATING TO INDEX SKEW NOTES

18. **Index Skew Notes:** Not Applicable

GENERAL PROVISIONS APPLICABLE TO THE SECURITIES

19. **Form of Securities:** Registered Securities
Regulation S Global Registered Security Certificate registered in the name of a nominee for a common depository for Euroclear and Clearstream, Luxembourg

20. **New Safekeeping Structure:** Not Applicable

21. **Business Centre(s):** New York City and T2 Business Day

22. **Business Day Jurisdiction(s) or other special provisions relating to payment dates:** New York City and T2 Business Day

23. **Redenomination, renominatisation and reconventioning provisions:** Applicable: The provisions of General Condition 18 (*Redenomination*) apply

24. **Consolidation provisions:** The provisions of General Condition 14 (*Further Issues*) apply

25. **Substitution provisions:** Applicable: The provisions of General Condition 17 (*Substitution of the Issuer, the CGMHI Guarantor and the CGMFL Guarantor*) apply

Additional Requirements: Not Applicable

26. **Name and address of Calculation Agent:** Citigroup Global Markets Limited (acting through its EMEA Equity Stocks Exotic Trading Desk (or any successor department/group)) at Citigroup Centre, Canada Square, Canary Wharf, London E14 5LB, United Kingdom

27. **Determination Agent:** Calculation Agent

28. **Determinations:**

(i) **Standard:** Sole and Absolute Determination

(ii) **Minimum Amount Adjustment Prohibition:** Not Applicable

29. **Determinations and Exercise of Discretion (BEC):** Not Applicable

30. **Prohibition of sales to consumers in Belgium:** Applicable

31. **Additional provisions applicable to Italian Listed Certificates:** Not Applicable
32. **Administrator/Benchmark Event:** Early Redemption following Administrator/Benchmark Event: Applicable
- Early Redemption Amount: Fair Market Value
- Deduction of Hedge Costs: Applicable
- Deduction of Issuer Costs and Hedging and Funding Costs: Applicable
- Pro Rata Issuer Cost Reimbursement: Not Applicable
- Additional Costs on account of Early Redemption: Not Applicable
33. **Details relating to Instalment Securities: amount of each Instalment Amount (including any maximum or minimum Instalment Amount), date on which each payment is to be made:** Not Applicable

363272641/Ashurst(EML/JEMELL)/EB

PART B – OTHER INFORMATION

1. LISTING AND ADMISSION TO TRADING:

Admission to trading and listing: Application will be made by the Issuer (or on its behalf) for the Securities to be admitted to trading on the Regulated Market of the Luxembourg Stock Exchange and to listing on the official list of the Luxembourg Stock Exchange with effect from on or around the Issue Date

2. RATINGS

Ratings: The Securities are not rated

3. INTERESTS OF NATURAL AND LEGAL PERSONS INVOLVED IN THE ISSUE/OFFER

Save for any fees payable to the Initial EEA Authorised Offeror(s), so far as the Issuer is aware, no person involved in the offer of the Securities has an interest material to the offer.

4. REASONS FOR THE OFFER, ESTIMATED NET PROCEEDS AND TOTAL EXPENSES

- (i) Reasons for the Offer: See "Use of Proceeds" in the Base Prospectus
- (ii) Estimated net proceeds: An amount equal to 100 per cent. of the final Aggregate Principal Amount of the Securities issued on the Issue Date
- For the avoidance of doubt, the estimated net proceeds reflect the proceeds to be received by the Issuer on the Issue Date. They are not a reflection of the fees payable by/to the Dealer and/or the Initial EEA Authorised Offeror(s)
- (iii) Estimated total expenses: Approximately USD 12,000 (listing fees and legal expenses)

5. INFORMATION ABOUT THE PAST AND FUTURE PERFORMANCE AND VOLATILITY OF THE OR EACH UNDERLYING

Information about the past and future performance of the or each Underlying is electronically available free of charge from the applicable Electronic Page(s) specified for such Underlying in Part A above.

6. EU BENCHMARKS REGULATION

EU Benchmarks Regulation: Article 29(2) The EURO STOXX® Utilities Price EUR Index is provided by STOXX Ltd.

As at the date hereof, STOXX Ltd. appears in the register of administrators and benchmarks established and maintained by ESMA pursuant to Article 36 of the EU Benchmarks Regulation

7. DISCLAIMER

EURO STOXX® Utilities Price EUR Index

STOXX Limited, Qontigo Index GmbH and their licensors, research partners or data providers have no relationship to the Issuer or the Dealer, other than the licensing of the EURO STOXX® Utilities Price EUR Index (the **SX6E Index**) and the related trademarks for use in connection with the Notes.

In case the SX6E Index is an iSTOXX or idDAX index, note that such indices are tailored to a customer request or market requirement based on an individualized rule book which is not integrated into the STOXX index family or DAX index family.

STOXX Limited, Qontigo Index GmbH and their licensors, research partners or data providers do not:

- sponsor, endorse, sell or promote the Notes or recommend that any person invest in the Notes or any other securities.
- have any responsibility or liability for or make any decisions about the timing, amount or pricing of the Notes.
- have any responsibility or liability for the administration, management or marketing of the Notes.
- consider the needs of the Notes or the owners of the Notes in determining, composing or calculating the SX6E Index or have any obligation to do so.

STOXX Limited and Qontigo Index GmbH respectively as the licensor and their licensors, research partners or data providers give no warranty, and exclude any liability (whether in negligence or otherwise), in connection with the Notes or their performance.

Specifically,

- STOXX Limited, Qontigo Index GmbH and their licensors, research partners or data providers do not give any warranty, express or implied, and exclude any liability about:
 - the results to be obtained by the Notes, the owner of the Notes or any other person in connection with the use of the SX6E Index and the data included in the SX6E Index;
 - the accuracy, timeliness, and completeness of the SX6E Index and its data;
 - the merchantability and the fitness for a particular purpose or use of the SX6E Index and its data;
 - the performance of the Notes generally.
- STOXX Limited, Qontigo Index GmbH and their licensors, research partners or data providers give no warranty and exclude any liability, for any errors, omissions or interruptions in the SX6E Index or its data;
- Under no circumstances will STOXX Limited, Qontigo Index GmbH or their licensors, research partners or data providers be liable (whether in negligence or otherwise) for any lost profits or indirect, punitive, special or consequential damages or losses, arising as a result of such errors, omissions or interruptions in the SX6E Index or its data or generally in relation to the Notes even in circumstances where STOXX Limited, Qontigo Index GmbH or their licensors, research partners or data providers are aware that such loss or damage may occur.

STOXX Limited and Qontigo Index GmbH do not assume any contractual relationship with the purchasers of the Notes or any other third parties. The licensing agreement between the Issuer and the respective licensors solely for their benefit and not for the benefit of the owners of the Notes or any other third parties.

Bloomberg®

Certain information contained in this Final Terms consists of extracts from or summaries of information that is publicly-available from Bloomberg L.P. (**Bloomberg®**). The Issuer and the CGMFL Guarantor accept responsibility for accurately reproducing such extracts or summaries and, as far as the Issuer and the CGMFL Guarantor are aware and are able to ascertain from such publicly-available information, no facts have been omitted which would render the reproduced information inaccurate or misleading. Bloomberg® makes no representation, warranty or undertaking, express or implied, as to the accuracy of the reproduction of such information, and accepts no responsibility for the reproduction of such information or for the merits of an investment in the Securities. Bloomberg® does not arrange, sponsor, endorse, sell or promote the issue of the Securities.

8. OPERATIONAL INFORMATION

ISIN Code:	XS2770636038
Common Code:	277063603
CUSIP:	5C298U9Y1
WKN:	Not Applicable
Valoren:	Not Applicable
CFI:	DEXXTX
FISN:	CITIGROUP GLOBA/UT 20280712

Any clearing system(s) other than Euroclear Bank S.A./N.V., Clearstream Banking, société anonyme and DTC and the relevant identification number(s) and details relating to the relevant depository, if applicable: Not Applicable

Delivery: Delivery versus payment

Names and address of the Swedish Securities Issuing and Paying Agent (if any): Not Applicable

Names and address of the Finnish Securities Issuing and Paying Agent (if any): Not Applicable

Names and address of the French Securities Issuing and Paying Agent (if any): Not Applicable

Names and addresses of additional Paying Agent(s) (if any): Not Applicable

Intended to be held in a manner which would allow Eurosystem eligibility: Not Applicable

9. DISTRIBUTION

- | | | |
|-------|---|--|
| (i) | Method of distribution: | Non-syndicated |
| (ii) | If syndicated, names and addresses of the Lead Manager and the other Managers and underwriting commitments: | Not Applicable |
| (iii) | Date of Subscription Agreement: | Not Applicable |
| (iv) | Stabilisation Manager(s) (if any): | Not Applicable |
| (v) | If non-syndicated, name and address of Dealer: | Citigroup Global Markets Europe AG at Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main, Germany |
| (vi) | Total commission and concession: | No commissions and concessions are payable by the Issuer to the Dealer |

The fee payable by the Dealer to the Initial EEA Authorised Offeror(s) shall not exceed 1.50 per cent. per annum per Specified Denomination.

Investors can obtain more information about the fees by contacting the Initial EEA Authorised Offeror(s)

(vii) Non-exempt Offer: An offer (the **Offer**) of the Securities may be made by OTP Bank Nyrt. (the **Initial EEA Authorised Offeror(s)**) other than pursuant to Article 1(4) and/or 3(2) of the EU Prospectus Regulation during the period from (and including) 19 June 2024 to (and including) 4 July 2024 (the **Offer Period**) in Hungary (**Hungary**)

Offers (if any) in any Member State other than the Public Offer Jurisdiction(s) will only be made pursuant to an exemption from the obligation under the EU Prospectus Regulation to publish a prospectus

EEA Authorised Offeror(s) means the Initial EEA Authorised Offeror(s)

Public Offer Jurisdiction(s) means Hungary

See further paragraph 10 below

(viii) General Consent: Not Applicable

(ix) Other conditions to consent: Not Applicable

(x) Prohibition of Sales to EEA Retail Investors: Not Applicable

(xi) Prohibition of Sales to UK Retail Investors: Applicable

10. TERMS AND CONDITIONS OF THE OFFER

Offer Price: The Offer Price in respect of each Calculation Amount offered by the EEA Authorised Offeror(s) to investors in Hungary (the **Offer Price**) is EUR 1,000 per Unit

Conditions to which the Offer is subject: The offer of the Securities for sale to the public in Hungary is subject to the relevant regulatory approvals having been granted, and the Securities being issued.

The Offer Period is subject to adjustment by or on behalf of the Issuer in accordance with the applicable regulations and any adjustments to such period will be published by way of notice which will be available on the website of the Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com).

The Offer Period in relation to the Offer of the Securities in Hungary may not be shorter than three Business Days.

The Issuer reserves the right, in its absolute discretion, to cancel, in whole or in part, the Offer and the issue of the Securities in Hungary at any time prior to the Issue Date in accordance with the applicable regulations

In such an event all application monies relating to applications for Securities under the Offer will be returned (without interest) to applicants at the applicant's risk by no later than 30 days after the date on which the Offer of the Securities is cancelled. Application monies will be returned by cheque mailed to the applicant's address as indicated on the application form, or by wire transfer to the bank account as detailed on the application form or by any other method as the Issuer deems to be appropriate

The Issuer shall publish a notice on the website of the Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com) in the event that the Offer is cancelled and the Securities are not issued in Hungary pursuant to the above

Description of the application process:

Applications for the purchase of Securities may be made by a prospective investor in Hungary to the EEA Authorised Offeror(s)

Pursuant to anti-money laundering laws and regulations in force in Hungary or other relevant jurisdictions, the Issuer, Citigroup Global Markets Europe AG or any of their authorised agents may require evidence in connection with any application for Securities, including further identification of the applicant(s), before any Securities are issued

Each prospective investor in Hungary should ascertain from the EEA Authorised Offeror(s) when the EEA Authorised Offeror(s) will require receipt of cleared funds from it in respect of its application for the purchase of any Securities and the manner in which payment should be made to the EEA Authorised Offeror(s)

Description of possibility to reduce subscriptions and manner for refunding excess amount paid by applicants:

The Issuer reserves the right, in its absolute discretion, to decline in whole or in part an application for Securities under the Offer in accordance with all applicable laws and regulations and/or in order to comply with any applicable laws and regulations. Accordingly, an applicant for Securities may, in such circumstances, not be issued the principal amount (or any) of the Securities for which it has applied

The Issuer also reserves the right to accept any subscriptions for Securities which would exceed the "up to" aggregate principal amount of the Securities and the Issuer may increase the "up to" aggregate principal amount of the Securities

Details of the minimum and/or maximum amount of application:

The minimum amount of application is one Unit (being EUR 1,000 in principal amount of the Securities)

	The maximum amount of application will be subject only to availability at the time of application
Details of the method and time limits for paying up and delivering the Securities:	Securities will be available on a delivery versus payment basis
	The Securities will be delivered to the purchaser's respective book-entry securities accounts on or around the date as notified by the EEA Authorised Offeror(s)
Manner in and date on which results of the offer are to be made public:	By means of a notice published by the Issuer on the website of the Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com)
Procedure for exercise of any right of pre-emption, negotiability of subscription rights and treatment of subscription rights not exercised:	Not Applicable
Whether tranche(s) have been reserved for certain countries:	Offers may be made by the EEA Authorised Offeror(s) to any person in Hungary
	Offers may only be made by offerors authorised to do so in Hungary. Neither the Issuer nor the Dealer has taken or will take any action specifically in relation to the Securities referred to herein to permit a public offering of such Securities in any jurisdiction other than Hungary
	Notwithstanding anything else in the Base Prospectus, the Issuer will not accept responsibility for the information given in the Base Prospectus or these Final Terms in relation to offers of Securities made by an offeror not authorised by the Issuer to make such offers
Process for notification to applicants of the amount allotted and the indication whether dealing may begin before notification is made:	Applicants in Hungary will be notified directly by the EEA Authorised Offeror(s) of the success of their application
Amount of any expenses and taxes specifically charged to the subscriber or purchaser:	See item 9(vi) (<i>Total commission and concession</i>) above
	For details of withholding taxes applicable to subscribers in Hungary see the section entitled " <i>Hungarian Taxation</i> " under " <i>Taxation of Securities</i> " in the Base Prospectus
Name(s), address(es), legal entity identifier, domicile, legal form and law and country of incorporation to the extent known to the Issuer, of the placers in the various countries where the offer takes place:	OTP Bank Nyrt. Nádor Street 16. Budapest, Hungary H-1051 LEI: 529900W3MOO00A18X956 OTP Bank Nyrt. is established in Hungary, operates as a publicly held joint stock company and is licenced by the Hungarian Financial Supervisory Authority (PSZÁF).

11. UNITED STATES TAX CONSIDERATIONS

General: The Securities are Non-U.S. Securities.

Section 871(m): The Issuer has determined that the Securities are not Specified ELIs for the purpose of Section 871(m).

ANNEX

SUMMARY OF THE SECURITIES

INTRODUCTION AND WARNINGS		
<p>The Summary should be read as an introduction to the Base Prospectus. Any decision to invest in the Securities should be based on a consideration of the Base Prospectus as a whole by the investor. In certain circumstances, the investor could lose all or part of the invested capital. Where a claim relating to the information contained in the Base Prospectus is brought before a court, the plaintiff investor might, under national law, have to bear the costs of translating the Base Prospectus before the legal proceedings are initiated. Civil liability attaches only to those persons who have tabled the Summary, including any translation thereof, but only where the Summary is misleading, inaccurate or inconsistent when read together with the other parts of the Base Prospectus or it does not provide, when read together with the other parts of the Base Prospectus, key information in order to aid investors when considering whether to invest in the Securities.</p> <p><i>You are about to purchase a product that is not simple and may be difficult to understand.</i></p>		
<p>The Securities: Issue of up to 25,000 Units (each Unit being EUR 1,000 in principal amount) of Autocall Notes linked to the EURO STOXX[®] Utilities Price EUR Index, due July 2028 (ISIN: XS2770636038)</p>		
<p>The Issuer: Citigroup Global Markets Funding Luxembourg S.C.A. Its registered office is at 31, Z.A. Bourmicht, L-8070 Bertrange, Grand Duchy of Luxembourg and its telephone number is +352 45 14 14 447. Its Legal Entity Identifier ("LEI") is 549300EVRWDFJUNNP53.</p>		
<p>The Authorised Offeror(s): The Authorised Offeror is OTP Bank Nyrt. (LEI: 529900W3MOO00A18X956), at Nádor Street 16. Budapest, Hungary H-1051</p>		
<p>Competent authority: The Base Prospectus was approved on 15 December 2023 by the Central Bank of Ireland of New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Ireland (Telephone number: +353 1 224 6000).</p>		
KEY INFORMATION ON THE ISSUER		
Who is the Issuer of the Securities?		
<p>Domicile and legal form of the Issuer, LEI, law under which the Issuer operates and country of incorporation: The Issuer was incorporated as a corporate partnership limited by shares (<i>société en commandite par actions</i>) on 24 May 2012 under the laws of Luxembourg for an unlimited duration and is registered with the Register of Trade and Companies of Luxembourg (<i>Registre de commerce et des sociétés, Luxembourg</i>) under number B 169.199. Its LEI is 549300EVRWDFJUNNP53.</p>		
<p>Issuer's principal activities: The Issuer grants loans and other forms of funding to Citigroup Inc. and its subsidiaries (the "Group"), and therefore may compete in any market in which the Group has a presence, and may finance itself in whatever form, including through issuance of the Securities, and carry on incidental activities.</p>		
<p>Major shareholders, including whether it is directly or indirectly owned or controlled and by whom: The shares of the Issuer are held by Citigroup Global Markets Funding Luxembourg GP S.à r.l. and Citigroup Global Markets Limited ("CGML" or the "Guarantor"). All of the issued share capital of CGML is owned by Citigroup Global Markets Holdings Bahamas Limited, which is an indirect subsidiary of Citigroup Inc.</p>		
<p>Key managing directors: The Issuer is managed by Citigroup Global Markets Funding Luxembourg GP S.à r.l. in its capacity as manager (the "Corporate Manager"). The members of the board of managers of the Corporate Manager are Mr. Eduardo Gramuglia Pallavicino, Ms. Silvia Carpitella, Mr. Vincent Mazzoli, Ms. Milka Krasteva and Mr. Dimba Kier.</p>		
<p>Statutory auditors: The Issuer's approved statutory auditor (<i>réviseur d'entreprises agréé</i>) is KPMG Audit S.à r.l. (formerly KPMG Luxembourg Société Coopérative) of 39, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxembourg.</p>		
What is the key financial information regarding the Issuer?		
<p>The following key financial information has been extracted from the audited non-consolidated financial statements of the Issuer for the years ended 31 December 2023 and 2022.</p>		
Summary information – income statement		
	Year ended 31 December 2023 (audited)	Year ended 31 December 2022 (audited)
Profit before income tax (<i>in thousands of U.S. dollars</i>)	227	203
Summary information – balance sheet		
	As at 31 December 2023 (audited)	As at 31 December 2022 (audited)
Net financial debt (long term debt plus short term debt minus cash) (<i>in thousands of U.S. dollars</i>)	24,823,075	27,115,261
Current ratio (current assets/current liabilities)	100%	100%
Debt to equity ratio (total liabilities/total shareholder equity)	17422%	21422%
Interest cover ratio (operating income/interest expense)*	Not Applicable	Not Applicable
Summary information – cash flow statement		
	Year ended 31 December 2023 (audited)	Year ended 31 December 2022 (audited)
Net cash flows from operating activities (<i>in thousands of U.S. dollars</i>)	157,770	(101,533)
Net cash flows from financing activities (<i>in thousands of U.S. dollars</i>)	(2,899,312)	6,764,831
Net cash flows from investing activities (<i>in thousands of U.S. dollars</i>)	2,899,305	(6,764,800)
<p>*In accordance with IFRS, the Issuer does not present any interest expenses.</p>		

Qualifications in audit report on historical financial information: There are no qualifications in the audit report of the Issuer on its audited historical financial information.

What are the key risks that are specific to the Issuer?

The Issuer is subject to the following key risks:

- The Issuer is subject to intra-group credit risk. From time to time, the Issuer enters into derivative transactions with CGML to offset or hedge its liabilities to securityholders under securities issued by it (which may include the Securities). As such, the Issuer is exposed to the credit risk of CGML in the form of counterparty risk in respect of such derivative transactions. In particular, the Issuer's ability to fulfil its obligations under the Securities is primarily dependent on CGML performing its counterparty obligations owed to the Issuer in respect of such derivative transactions in a timely manner, and any failure by CGML to do so will negatively affect the ability of the Issuer to fulfil its obligations under the Securities. Securityholders will not have any recourse to CGML under any such derivative transactions.
- The Issuer may not be able to maintain its current ratings. If a rating agency reduces, suspends or withdraws its rating of the Issuer and/or any affiliate thereof, the liquidity and market value of the Securities are likely to be adversely affected. Ratings downgrades could also have a negative impact on other funding sources, such as secured financing and other margin requirements, for which there are no explicit triggers.
- Following the military action by Russia in Ukraine, the U.S. has imposed, and is likely to impose material additional, financial and economic sanctions and export controls against certain Russian organisations and/or individuals, with similar actions implemented and/or planned by the European Union, the UK and other jurisdictions. The Group's ability to engage in activity with certain consumer and institutional businesses in Russia and Ukraine or involving certain Russian or Ukrainian businesses and customers is dependent in part upon whether such engagement is restricted under any current or expected U.S., European Union, UK or other countries' sanctions and laws, or is otherwise discontinued in light of these developments. Sanctions and export controls, as well as any actions by Russia, could adversely affect the Group's business activities and customers in and from Russia and Ukraine. Any negative impact of Russia's actions in Ukraine, and related sanctions, export controls and similar actions or laws on the Group, including the Issuer, could adversely affect the ability of the Issuer to fulfil its obligations under the Securities, and the value of and return on the Securities may also be adversely affected.

KEY INFORMATION ON THE SECURITIES

What are the main features of the Securities?

Type and class of Securities, including security identification numbers

The Securities are derivative securities in the form of notes issued in Units, and are linked to an underlying security index. The Securities will be cleared and settled through Euroclear Bank S.A./N.V. and/or Clearstream Banking, *société anonyme*.

The issue date of the Securities is 12 July 2024. The issue price of the Securities is EUR 1,000 per Unit.

Series Number: CGMFL80176; ISIN: XS2770636038; Common Code: 277063603; CFI: DEXXTX; FISN: CITIGROUP GLOBA/UT 20280712; CUSIP: 5C298U9Y1.

Currency, specified denomination, calculation amount, aggregate principal amount and maturity date of the Securities

The Securities are denominated in Euro ("EUR"). The Securities have a specified denomination of 1 Unit and the calculation amount is 1 Unit. The aggregate principal amount of the Securities to be issued is up to 25,000 Units (each Unit being EUR 1,000 in principal amount of the Securities). The Securities are issued in Units. Accordingly, references herein to Units shall be deemed to be references to EUR 1,000 in principal amount of the Securities and all references to payments and/or deliveries being made in respect of a Security shall be construed to such payments and/or deliveries being made in respect of a Unit.

Maturity Date: 12 July 2028. This is the date on which the Securities are scheduled to redeem, subject to an early redemption of the Securities.

Rights attached to the Securities

The Securities do not bear or pay any interest. The return on the Securities will derive from the potential payment of a Mandatory Early Redemption Amount following early redemption of the Securities due to the occurrence of a Mandatory Early Redemption Barrier Event, and, unless the Securities have been previously redeemed or purchased and cancelled, the payment of the Redemption Amount on the Maturity Date of the Securities.

Mandatory Early Redemption Amount: If, in respect of a Mandatory Early Redemption Date, a Mandatory Early Redemption Barrier Event has occurred, the Securities will be redeemed on the relevant Mandatory Early Redemption Date at an amount for each Security equal to the amount specified as the Mandatory Early Redemption Amount for the relevant Mandatory Early Redemption Date in the table below. If the Securities are redeemed early, no further amounts shall be paid after the Mandatory Early Redemption Date.

Where:

Mandatory Early Redemption Barrier Event: in respect of a Mandatory Early Redemption Date, if on the related Mandatory Early Redemption Barrier Observation Date, the underlying closing level of the Underlying is greater than or equal to the relevant Mandatory Early Redemption Barrier Level.

Mandatory Early Redemption Barrier Level: in respect of a Mandatory Early Redemption Date, the percentage specified for such Mandatory Early Redemption Date and the Underlying in the table below.

Mandatory Early Redemption Barrier Observation Date: in respect of a Mandatory Early Redemption Date, each date specified as such for such Mandatory Early Redemption Date in the table below, subject to adjustment.

Mandatory Early Redemption Date: each date specified as such in the table below.

Mandatory Early Redemption Initial Level or MER Initial Level: in respect of the Underlying, the underlying closing level for such Underlying for the Mandatory Early Redemption Strike Date.

Mandatory Early Redemption Strike Date: 5 July 2024, subject to adjustment.

Mandatory Early Redemption Barrier Level	Mandatory Early Redemption Barrier Observation Date	Mandatory Early Redemption Amount	Mandatory Early Redemption Date
100.00% of the MER Initial Level of the Underlying	7 July 2025	EUR 1,072.50	14 July 2025
100.00% of the MER Initial Level of the Underlying	6 July 2026	EUR 1,145	13 July 2026
100.00% of the MER Initial Level of the Underlying	5 July 2027	EUR 1,217.50	12 July 2027

Redemption Amount: Unless the Securities have been previously redeemed or purchased and cancelled, if:

- (a) a Redemption Barrier Event has not occurred, the Issuer shall redeem each Security on the Maturity Date at an amount equal to EUR 1,290; or
- (b) a Redemption Barrier Event has occurred and:
 - (i) if a Redemption Lower Barrier Event has not occurred, the Issuer shall redeem each Security on the Maturity Date at an amount equal to EUR 1,000;
 - (ii) if a Redemption Lower Barrier Event has occurred, the Issuer shall redeem each Security on the Maturity Date at an amount equal to the product of (a) the Calculation Amount and (b) the sum of 100.00% and the Final Performance of the Underlying. Expressed as a formula:

$$CA \times (100.00\% + \text{Final Performance of the Underlying})$$

Where:

Calculation Amount or CA: EUR 1,000.

Final Barrier Level: 100.00% of the Redemption Initial Level of the Underlying.

Final Performance: in respect of the Underlying, an amount expressed as a percentage equal to such Underlying's Final Reference Level less its Redemption Strike Level, all divided by its Redemption Initial Level. Expressed as a formula:

$$\frac{\text{Final Reference Level} - \text{Redemption Strike Level}}{\text{Redemption Initial Level}}$$

Final Reference Level: in respect of the Underlying, the underlying closing level for such Underlying on the Final Valuation Date.

Final Valuation Date(s): 5 July 2028, subject to adjustment.

Redemption Barrier Event: if on the related Redemption Barrier Observation Date, the underlying closing level of the Underlying is less than the Final Barrier Level.

Redemption Barrier Observation Date: 5 July 2028, subject to adjustment.

Redemption Initial Level: in respect of the Underlying, the underlying closing level for such Underlying for the Redemption Strike Date.

Redemption Lower Barrier Event: if on the related Redemption Lower Barrier Event Valuation Date, the underlying closing level of the Underlying is less than the Redemption Lower Barrier Percentage.

Redemption Lower Barrier Event Valuation Date: 5 July 2028, subject to adjustment.

Redemption Lower Barrier Percentage: 65.00% of the Redemption Initial Level of the Underlying.

Redemption Strike Date: 5 July 2024, subject to adjustment.

Redemption Strike Level: in respect of the Underlying, the Redemption Initial Level of such Underlying.

The Underlying(s)	
Description	Electronic page
EURO STOXX® Utilities Price EUR Index (ISIN: EU0009658582)	Bloomberg Page: SX6E <Index>

Early redemption: The Securities may be redeemed early following the occurrence of certain specified events or circumstances (for example, including an event affecting the Underlying(s) or the Issuer's hedging arrangements, an event of default, and circumstances relating to taxation and illegality) at an amount which will be determined by the calculation agent in accordance with the terms and conditions of the Securities.

Adjustments: The terms and conditions of the Securities contain provisions, including provisions relating to events affecting the Underlying(s) or hedging arrangements in respect of the Securities, market disruption provisions and provisions relating to subsequent corrections of the level of the Underlying(s) and details of the consequences of such events. Such provisions may where applicable permit adjustments to be made to the terms and conditions of the Securities. The terms and conditions of the Securities also permit the adjustment of payment dates for non-business days.

Meetings: The terms and conditions of the Securities contain provisions for calling meetings of holders to consider matters affecting their interests generally. These provisions permit defined majorities to bind all holders, including holders who did not attend and vote at the relevant meeting and holders who voted in a manner contrary to the majority.

Governing law: The Securities will be governed by English law.

Bail-in: Any exercise of any bail-in power or other action taken by a resolution authority in respect of the Guarantor could materially adversely affect the value of and return on the Securities.

Status of the Securities: The Securities constitute direct, unconditional, unsubordinated and unsecured obligations of the Issuer and will at all times rank *pari passu* and rateably among themselves and at least *pari passu* with all other unsecured and unsubordinated outstanding obligations of the Issuer, save for such obligations as may be preferred by provisions of law that are both mandatory and of general application.

Description of restrictions on free transferability of the Securities

The Securities will be transferable, subject to offering, selling and transfer restrictions of the laws of any jurisdiction in which the Securities are offered or sold.

Where will the Securities be traded?

Application will be made by the Issuer (or on its behalf) for the Securities to be admitted to trading on the Regulated Market of the Luxembourg Stock Exchange and to listing on the official list of the Luxembourg Stock Exchange with effect from on or around the issue date.

Is there a guarantee attached to the Securities?

Brief description of the Guarantor: CGML is a private company limited by shares and was incorporated in England and Wales on 21 October 1983. CGML operates under the laws of England and Wales and is domiciled in England. Its registered office is at Citigroup Centre, Canada Square, Canary Wharf, London E14 5LB and its telephone number is +44 (0)207 986 4000. The registration number of CGML is 01763297 on the register maintained by Companies House. Its LEI is XKZZ2JZF41MRHTR1V493. CGML is a wholly-owned indirect subsidiary of Citigroup Inc. and has a major international presence as a dealer, market maker and underwriter, as well as providing advisory services to a wide range of corporate, institutional and government clients.

Nature and scope of guarantee: The Securities issued will be unconditionally and irrevocably guaranteed by CGML pursuant to a deed of guarantee, which constitutes direct, unconditional, unsubordinated and unsecured obligations of CGML and ranks and will rank at least *pari passu* with all other outstanding, unsecured and unsubordinated obligations of CGML, save for such obligations as may be preferred by provisions of law that are both mandatory and of general application.

Key financial information of the Guarantor: The following key financial information has been extracted from the audited non-consolidated financial statements of the Guarantor for the years ended 31 December 2023 and 2022.

Summary information – income statement		
	Year ended 31 December 2023 (audited)	Year ended 31 December 2022 (audited)
Profit after taxation (<i>in millions of U.S. dollars</i>)	190	278
Summary information – balance sheet		
	As at 31 December 2023 (audited)	As at 31 December 2022 (audited)
Net financial debt (long term debt plus short term debt minus cash) (<i>in millions of U.S. dollars</i>)	6,460	14,668
Debt to equity ratio (total liabilities/total shareholder equity)	16.2	15.7
Summary information – cash flow statement		
	Year ended 31 December 2023 (audited)	Year ended 31 December 2022 (audited)
Net cash flows from operating activities (<i>in millions of U.S. dollars</i>)	724	(2,689)
Net cash flows from financing activities (<i>in millions of U.S. dollars</i>)	653	2,237
Net cash flows from investing activities (<i>in millions of U.S. dollars</i>)	(1,095)	(586)

Qualifications in audit report on historical financial information: There are no qualifications in the audit report of the Guarantor on its audited historical financial information.

Key risks in respect of the Guarantor: The Guarantor is subject to the following key risks:

- The Guarantor is exposed to concentrations of risk, particularly credit and market risk. As regulatory or market developments continue to lead to increased centralisation of trading activities, the Guarantor could experience an increase in concentration of risk, which could limit the effectiveness of any hedging strategies and cause the Guarantor to incur significant losses. The Guarantor may be affected by macroeconomic, geopolitical and other challenges, uncertainties and volatilities, including the global COVID-19 pandemic and the military action by Russia in Ukraine (and related sanctions, export controls and similar actions or laws), which may negatively impact the businesses of the Guarantor and its ability to fulfil its obligations under the Securities, and the value of and return on the Securities.
- The Guarantor may not be able to maintain its current ratings. If a rating agency reduces, suspends or withdraws its rating of the Guarantor and/or any affiliate thereof, the liquidity and market value of the Securities are likely to be adversely affected. Ratings downgrades could also have a negative impact on other funding sources, such as secured financing and other margin requirements, for which there are no explicit triggers.
- If the relevant resolution authority is satisfied that the Guarantor is failing or likely to fail, and subject to certain other conditions being satisfied, the Guarantor may be subject to action taken by the resolution authority, including potentially the write down of claims of unsecured creditors of the Guarantor (such as under the deed of guarantee) and the conversion of unsecured debt claims (such as under the deed of guarantee) to other instruments (e.g. equity shares), the transfer of all or part of the Guarantor's business to another entity, or other resolution measures. As a result of any such action, investors could lose some or all of their investment in the Securities.

What are the key risks that are specific to the Securities?

The Securities are subject to the following key risks:

- You should be prepared to sustain a total or partial loss of the purchase price of your Securities. The value of Securities prior to their scheduled redemption may vary due to a number of interrelated factors, including the value, dividend yield and volatility of the Underlying(s) and any changes in interim interest rates if applicable, and a sale of Securities prior to their scheduled redemption may be at a substantial discount from the original purchase price and you may lose some or all of your investment. If, at maturity, a Redemption Barrier Event and a Redemption Lower Barrier Event have occurred, the Securities may be redeemed for less than your initial investment or even zero. Further, you will receive no interest during the term of the Securities.
- The Issuer's obligations under the Securities and the Guarantor's obligations under the deed of guarantee represent general contractual obligations of each respective entity and of no other person. Accordingly, payments under the Securities are subject to the credit risk of the Issuer and the Guarantor. Securityholders will not have recourse to any secured assets of the Issuer and Guarantor in the event that the Issuer or Guarantor is unable to meet its obligations under the Securities, including in the event of an insolvency, and therefore risk losing some or all of their investment.
- Securities may have no established trading market when issued, and one may never develop, so investors should be prepared to hold the Securities until maturity. If a market does develop, it may not be very liquid. Consequently, you may not be able to sell your Securities easily or at all or at prices equal to or higher than your initial investment and in fact any such price may be substantially less than the original purchase price. Illiquidity may have a severely adverse effect on the market value of Securities.
- Amounts due in respect of the Securities are linked to the performance of the Underlying(s), which is a security index. Global economic, financial and political developments, among other things, may have a material effect on the value of the component securities of, and/or the performance of, the Underlying(s), and in recent years, currency exchange rates and prices for component securities have been highly volatile. This may in turn affect the value of and return on the Securities. Where the Underlying(s) is a price return index, holders of Securities will not participate in dividends paid on the components comprising the Underlying(s) and such Securities may not perform as well as a position where such holder had invested directly in such components or where they invested in a "total return" version of the Underlying(s) or in another product.
- The Securities do not create an actual interest in, or ownership of, an Underlying. A Security will not represent a claim against an Underlying and, in the event that the amount paid on redemption of the Securities is less than your investment, you will not have recourse under any relevant Security to an Underlying or other items which may comprise the Underlying(s) in respect of such Securities. You will have no legal or beneficial interest in an Underlying. You may receive a lower return on the Securities than you would have received had you invested directly in an Underlying or through another product.
- The terms and conditions of Securities include provisions dealing with the postponement of dates on which the level of an Underlying is scheduled to be taken. Such postponement or alternative provisions for valuation provided in the terms and conditions of the Securities may have an adverse effect on the value of such Securities.
- The calculation agent may make adjustments to the terms of the Securities to account for the effect of certain adjustment events occurring in respect of the Securities or an Underlying and/or hedging arrangements, or may replace an Underlying with a new security index. Any such adjustments may have an adverse effect on the value of such Securities.
- In certain circumstances (for example, if the calculation agent determines that no calculation, adjustment or substitution can reasonably be made, following an event of default or certain events affecting an Underlying or the Issuer's hedging arrangements, or for reasons relating to taxation or illegality), the Securities may be early redeemed. If the Securities are redeemed early, the amount paid may be less than your initial investment and you may therefore sustain a loss.
- Following the occurrence of a Mandatory Early Redemption Barrier Event, the Securities will be redeemed on the relevant Mandatory Early Redemption Date at the relevant Mandatory Early Redemption Amount. No further amount shall be payable in respect of the Securities after the Mandatory Early Redemption Date. In this case, you are subject to a reinvestment risk, as you may not be able to replace your investment in the Securities with an investment that has a similar profile of chances and risks as the Securities.

KEY INFORMATION ON THE OFFER OF SECURITIES TO THE PUBLIC AND/OR ADMISSION TO TRADING ON A REGULATED MARKET

Under which conditions and timetable can I invest in the Securities?

Terms and conditions of the offer

An offer of the Securities will be made in Hungary during the period from (and including) 19 June 2024 to (and including) 4 July 2024. Such period may be adjusted by the Issuer. The Offer Period in relation to the Offer of the Securities in Hungary may not be shorter than three business days. The Issuer reserves the right to cancel the offer of the Securities.

The offer price is EUR 1,000 per calculation amount. The minimum amount of application is one Unit (being EUR 1,000 in principal amount of the Securities). The maximum amount of application will be subject only to availability at the time of application. The Issuer may decline in whole or in part an application for the Securities and/or accept subscriptions which would exceed the "up to" aggregate principal amount of the Securities and the Issuer may increase the "up to" aggregate principal amount of the Securities.

Description of the application process: Applications for the purchase of Securities may be made by a prospective investor in Hungary to the Authorised Offeror. Each prospective investor in Hungary should ascertain from the Authorised Offeror when the Authorised Offeror will require receipt of cleared funds from it in respect of its application for the purchase of any Securities and the manner in which payment should be made to the Authorised Offeror.

Details of method and time limits for paying up and delivering the Securities: Securities will be available on a delivery versus payment basis. The Issuer estimates that the Securities will be delivered to the purchaser's respective book-entry securities accounts on or around the issue date.

Manner in and date on which results of the offer are to be made public: By means of a notice published by the Issuer on the website of the Luxembourg Stock Exchange (www.luxse.com).

Estimated expenses or taxes charged to investor by issuer/offeror

No commissions and concessions are payable by the Issuer to the dealer. The fee payable by the dealer to the Authorised Offeror(s) shall not exceed 1.50 per cent. per annum per specified denomination. Investors can obtain more information about the commission by contacting the Authorised Offeror(s).

Who is the offeror and/or the person asking for admission to trading?

The Issuer is the entity requesting for the admission to trading of the Securities.

Authorised Offeror(s): The Authorised Offeror is OTP Bank Nyrt. (LEI: 529900W3MOO00A18X956), at Nádor Street 16. Budapest, Hungary H-1051. OTP Bank Nyrt. is established in Hungary, operates as a publicly held joint stock company and is licenced by the Hungarian Financial Supervisory Authority (PSZÁF).

Why is the Prospectus being produced?

Use and estimated net amount of proceeds

The net proceeds of the issue of the Securities will be used primarily to grant loans or other forms of funding to CGML and any entity belonging to the same Group, and may be used to finance the Issuer itself. The estimated net amount of proceeds is an amount equal to 100.00 per cent. of the final aggregate principal amount of the Securities issued on the issue date.

Underwriting agreement on a firm commitment basis: The offer of the Securities is not subject to an underwriting agreement on a firm commitment basis.

Description of any interest material to the issue/offer, including conflicting interests

Fees are payable to the distributor(s). The terms of the Securities confer on the Issuer, the calculation agent and certain other persons discretion in making judgements, determinations and calculations in relation to the Securities. Potential conflicts of interest may exist between the Issuer, calculation agent and holders of the Securities, including with respect to such judgements, determinations and calculations. The Issuer, CGML and/or any of their affiliates may also from time to time engage in transactions or enter into business relationships for their own account and/or possess information which affect or relate to the Securities and/or the Underlying(s). The Issuer, CGML and/or any of their affiliates have no obligation to disclose to investors any such information and may pursue actions and take steps that they deem necessary or appropriate to protect their interests without regard to the consequences for investors. Save as described above, so far as the Issuer is aware, no person involved in the offer of the Securities has an interest material to the offer.

ÉRTÉKPAPÍROKKAL KAPCSOLATOS ÖSSZEFOGLALÓ

BEVEZETÉS ÉS FIGYELMEZTETÉSEK		
<p>Ez az összefoglaló az Eredeti Alaptájékoztató bevezetőjének tekintendő. Az Értékpapírok vonatkozásában befektetői döntést csak az Eredeti Alaptájékoztató egészét figyelembe véve lehet meghozni. Bizonyos esetekben a befektetők a befektetésük jelentős részét vagy egészét elveszíthetik. Amennyiben az Eredeti Alaptájékoztatóban foglalt információkkal kapcsolatosan kereset indításra kerül sor, előfordulhat, hogy az érintett Tagállam nemzetközi jogszabályai alapján a felperesnek kell viselnie a bírósági eljárás megindítását megelőzően az Eredeti Alaptájékoztató fordítási költségeit. Kizárólag azon személyeket terheli polgári jogi felelősség, akik a jelen Összefoglalót, ideértve az Összefoglaló bármely fordítását is, összeállították, de csak abban az esetben, ha az Összefoglaló vagy annak fordítása félrevezető, pontatlan vagy nincs összhangban az Eredeti Alaptájékoztató egyéb részeivel, vagy amennyiben az összefoglaló az Eredeti Alaptájékoztatóval együtt olvasva sem tartalmazza a befektetők Értékpapírokra vonatkozó befektetési döntését elősegítő kiemelt információkat.</p> <p>Az Ön által megvásárolni tervezett termék bonyolult és nehezen érthető.</p>		
<p>Az Értékpapírok: legfeljebb 25.000 Darabban (minden egyes Darab 1.000 euró tőkeösszeget testesít meg) kibocsátandó, 2028. júliusban lejáró, "Autocall Notes" elnevezésű és az EURO STOXX® Utilities Price EUR Index teljesítményéhez kötött Értékpapírok (ISIN kód: XS2770636038).</p>		
<p>A Kibocsátó: Citigroup Global Markets Funding Luxembourg S.C.A., székhely: 31, Z.A. Bourmicht, L-8070 Bertrange, Luxemburgi Nagyhercegség, telefonszám: +352 45 14 14 447, LEI azonosító ("LEI"): 549300EVRWDFJUNNP53.</p>		
<p>Felhatalmazott Forgalmazó(k): A Felhatalmazott Forgalmazó: OTP Bank Nyrt. amelynek székhelye 1051 Budapest, Nádor utca 16. cím alatt található. LEI azonosítója: 529900W3MOO0A18X956</p>		
<p>Illetékes hatóság: Az Eredeti Alaptájékoztatót 2023. december 15.-én az Ír Központi Bank (székhely: New Wapping Street, North Wall Quay, Dublin 1, D01 F7X3, Írország; telefonszám: +353 1 224 6000) hagyta jóvá.</p>		
KIBOCSÁTÓRA VONATKOZÓ KIEMELT INFORMÁCIÓK		
Ki az Értékpapírok kibocsátója?		
<p>A Kibocsátó székhelye és jogi formája, LEI kódja, a Kibocsátó tevékenységére irányadó jog és a kibocsátó székhely szerinti országa: A Kibocsátó egy részvényekkel alapított, a Luxemburgi Nagyhercegség joga alapján 2012. május 24-én határozatlan időre – a Luxemburgi Cégbíróságon B 169.199 nyilvántartási számon – bejegyzett betéti társaság (<i>société en commandite par actions</i>). LEI azonosítója: 549300EVRWDFJUNNP53.</p>		
<p>A Kibocsátó főbb tevékenységei: A Kibocsátó a Citigroup Inc. és annak leányvállalatai (a Csoport) számára kölcsönöket és finanszírozást nyújt. Ennélfogva a Kibocsátó minden olyan piacon versenyez, amelyen a Csoport jelenléttel bír, valamint a Kibocsátó bármilyen formában finanszírozhatja magát – az Értékpapírok kibocsátását is ideértve – és kiegészítő tevékenységeket is végezhet.</p>		
<p>Főbb részvényesek, ideértve a Kibocsátót közvetlenül vagy közvetve tulajdonló vagy ellenőrző személyeket is: A Kibocsátó részvényesei a Citigroup Global Markets Funding Luxembourg GP S.à r.l. és a Citigroup Global Markets Limited ("CGML" vagy a "Garanciavállaló"). A CGML egyedüli részvényese a Citigroup Global Markets Holdings Bahamas Limited, amely a Citigroup Inc. közvetett leányvállalata.</p>		
<p>Főbb vezető tisztségviselők: A Kibocsátó ügyvezetését a Citigroup Global Markets Funding Luxembourg GP S.à r.l. látja el mint ügyvezető (a "Társasági Ügyvezető"). A Társasági Ügyvezető ügyvezetői testületének tagjai Alberta Brusi, Vincent Mazzoli, Milka Krasteva és Dimba Kier.</p>		
<p>Könyvvizsgáló: A Kibocsátó megbízott könyvvizsgálója (<i>réviseur d'entreprises agréé</i>) a KPMG Audit S.à r.l. (eredeti nevén: KPMG Luxembourg Société Coopérative) of 39, avenue J.F. Kennedy, L-1855, Luxemburg.</p>		
Melyek a Kibocsátóra vonatkozó kiemelt pénzügyi információk?		
<p>Az alábbi kiemelt pénzügyi információ a Kibocsátónak a 2023. december 31.-ével és 2021. december 31.-ével lezárt évekre vonatkozó auditált, nem konszolidált éves beszámolóiból került beillesztésre.</p>		
Összevont információk – Eredménykimutatás		
	2023. december 31.-ével lezárt év (auditált)	2022. december 31.-ével lezárt év (auditált)
Jövedelemadó előtti nyereség (ezer amerikai dollárban)	227	203
Összevont információk – mérleg		
	2023. december 31. (auditált)	2022. december 31. (auditált)
Nettó pénzügyi adósság (hosszú távú adósság plusz rövid távú adósság mínusz készpénz) (ezer amerikai dollárban)	24.823.075	27.115.261
Forgóeszköz hányados (forgó eszközök / forgó kötelezettségek)	100%	100%

Részvénytőkéhez viszonyított adósság mutató (összes kötelezettség / összes részvényesi tőke)	17422%	21422%
Kamat fedezeti mutató (működési bevétel / kamat kiadás)*	Nem alkalmazandó	Nem alkalmazandó
Összevont információk – cash flow kimutatás		
	2023. december 31.-ével lezárt év (auditált)	2022. december 31.-ével lezárt év (auditált)
Működési tevékenységből származó nettó cash flow (ezer amerikai dollárban)	157.770	(101.533)
Finanszírozásból származó nettó cash flow (ezer amerikai dollárban)	(2.899.312)	6.764.831
Befektetésekből származó nettó cash flow (ezer amerikai dollárban)	2.899.305	(6.764.800)

*A Kibocsátó az IFRS-el összhangban nem mutatja be a kamatkiadásokat.

A múltbéli pénzügyi tájékoztatással kapcsolatos könyvvizsgálói jelentésben tett záradékok: A Kibocsátó auditált múltbéli pénzügyi információi tekintetében a könyvvizsgáló nem tett záradékot.

Melyek a Kibocsátóra vonatkozó kiemelt kockázati tényezők?

A Kibocsátóra vonatkozó kiemelt kockázati tényezők a következők:

- A Kibocsátó ki van téve a csoporton belüli hitelezési kockázatnak. A Kibocsátó időről időre származtatott ügyleteket köt a CGML-el a Kibocsátó által kibocsátott értékpapírok (ideértve adott esetben az Értékpapírokat is) tulajdonosai felé fennálló kötelezettségeinek ellentételezése vagy fedezése céljából. Ebből kifolyólag az ezen származtatott ügyleteket értő partnerkockázat formájában a Kibocsátó ki van téve a CGML-el kapcsolatos hitelezési kockázatoknak. A Kibocsátónak az Értékpapírokkal kapcsolatos kötelezettségeinek a teljesítésére vonatkozó képessége elsődlegesen a CGML-nek a Kibocsátó felé a fent említett származtatott ügyletek alapján fennálló partner kötelezettségei esedékességekori teljesítésétől függ. A CGML teljesítésének az elmulasztása negatívan befolyásolhatja a Kibocsátó Értékpapírokkal kapcsolatos kötelezettségeinek a teljesítésére vonatkozó képességét. Az Értékpapírok tulajdonosai a fenti származtatott ügyletek tekintetében nem jogosultak a CGML-el szemben igényeket érvényesíteni.
- Előfordulhat, hogy a Kibocsátó nem lesz képes a jelenlegi hitelminősítéseinek a fenntartására. Amennyiben egy hitelminősítő csökkenti, felfüggeszti vagy visszavonja a Kibocsátó és / vagy bármely kapcsolt vállalkozása hitelminősítését, ez hátrányos hatással lehet az Értékpapírok likviditására és piaci értékére. A hitelminősítésekkel kapcsolatos leminősítések negatív hatással lehetnek az egyéb finanszírozási forrásokra is, ideértve a biztosítékalapú finanszírozást és egyéb biztosíték nyújtással kapcsolatos követelményeket is, amelyek alkalmazása tekintetében nincsenek kifejezett kizáróhatások.
- Oroszország ukrajnai katonai akciója következtében az Egyesült Államok pénzügyi és gazdasági szankciókat és exportellenőrzéseket vezetett be, és valószínűleg további jelentős szankciókat fog bevezetni egyes orosz szervezetekkel és/vagy személyekkel szemben, és hasonló intézkedéseket vezetett be és/vagy tervez bevezetni az Európai Unió, az Egyesült Királyság és más joghatóságok is. Az, hogy a Csoport képes lesz-e Oroszországban és Ukrajnában bizonyos fogyasztói és intézményi vállalkozásokkal, illetve bizonyos orosz vagy ukrán vállalkozások és ügyfelek bevonásával tevékenységet folytatni részben attól függ, hogy az Egyesült Államok, az Európai Unió, az Egyesült Királyság vagy más országok jelenlegi vagy várható szankciói és törvényei korlátozzák-e vagy más módon nem szüntetik-e meg az ilyen tevékenységet az említett fejlemények fényében. A szankciók és az exportellenőrzések, valamint az Oroszország által hozott intézkedések hátrányosan befolyásolhatják a Csoport Oroszországban és Ukrajnában folytatott vagy onnan eredő üzleti tevékenységét és ügyfeleit. Oroszország ukrajnai akcióinak, valamint a kapcsolódó szankcióknak, exportellenőrzéseknek és hasonló intézkedéseknek vagy törvényeknek bármilyen negatív hatása a Csoportra nézve, beleértve a Kibocsátót is, hátrányosan befolyásolhatja a Kibocsátó Értékpapírokból eredő kötelezettségeinek teljesítésére vonatkozó képességét, valamint az Értékpapírok értékét és hozamát is hátrányosan befolyásolhatja.

ÉRTÉKPAPÍROKRA VONATKOZÓ KIEMELT INFORMÁCIÓK

Melyek az Értékpapírok főbb jellemzői?

Értékpapírok típusa és osztálya, ideértve az értékpapír-azonosító számokat is

Az Értékpapírok származtatott, hitelviszonyt megtestesítő értékpapír formájában kibocsátandó értékpapírok, amelyek hozama a mögöttes értékpapír index hozamához kötött. Az Értékpapírok elszámolására az Euroclear Bank S.A./N.V. és/vagy a Clearstream Banking, *société anonyme* elszámolóházakon keresztül fog sor kerülni.

Az Értékpapírok kibocsátási dátuma 2024. július 12. Az Értékpapírok kibocsátási ára Értékpapíronként 1.000 eurónak megfelelő összeg.

Sorozatszám: CGMFL80176; ISIN kód: XS2770636038; Közös kód: 277063603; CUSIP kód: 5C298U9Y1; CFI kód: DEXXTX; FISN kód: CITIGROUP GLOBA/UT 20280712.

Az Értékpapírok devizaneme, számítási összege, az Értékpapírok darabszáma és elszámolási napja

Az Értékpapírok devizaneme euró (EUR). Az Értékpapírok meghatározott névértéke 1 Egység és a számítási összeg ugyancsak 1 Egység. A kibocsátható Értékpapírok összesített tőkeösszege legfeljebb 25,000 Egység (Egységenként 1.000 eurós tőkeösszeggel). Az Értékpapírok Egységekben kerülnek kibocsátásra. Ennek megfelelően a jelen dokumentumban az Egységre történő hivatkozások egyben az Értékpapírok 1.000 eurós tőkeösszegére történő hivatkozásnak is tekintendők, és az Értékpapírok

tekintetében eszközrendő kifizetések és/vagy leszállítások egy Egység tekintetében teljesítendő kifizetéseknek és/vagy leszállításoknak tekintendők.

Lejárat Nap: 2028. július 12.-e. Az Értékpapírok tervezett lejárására ezen a napon kerülne sor, feltéve hogy az Értékpapírok lejárati előtti visszaváltására nem kerül sor.

Az Értékpapírokhoz fűződő jogok

Az Értékpapírok nem kamatoznak. Az Értékpapírok után fizetendő hozam a következő elemekből áll: az Értékpapíroknak a Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Esemény következtében történő lejárati előtti visszaváltásakor adott esetben fizetendő Lejárati Előtti Visszaváltási Összeg, továbbá az Értékpapírok Lejárati Napján – feltéve, hogy az Értékpapírok lejárati előtti visszaváltására, megvásárlására vagy törlésére nem kerül sor – a Visszaváltási Összeg megfizetése.

Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Összeg: Amennyiben egy Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Napon egy Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Esemény következik be, az Értékpapírok az adott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Napon Értékpapíronként egy olyan összegben kerülnek visszaváltásra, amely megegyezik az alábbi táblázatban az adott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Nap tekintetében meghatározott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Összeggel. Az Értékpapírok lejárati előtti visszaváltása esetén a Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Napot követően további összegek kifizetésére nem kerül sor.

A fentiek alkalmazásában:

Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Esemény: valamely Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Nap tekintetében azt jelenti, ha az adott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Megfigyelési Napon a Mögöttes Eszköz záraskori értéke meghaladja vagy eléri az adott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Értéket.

Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Érték: az alábbi táblázatban az adott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Nap és Mögöttes Eszköz tekintetében meghatározott százalékos értéket jelenti.

Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Megfigyelési Nap: az adott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Nap tekintetében az alábbi táblázatban az adott Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Naphoz rendelt napot jelenti, kiigazítások függvényében.

Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Nap: az alábbi táblázatban ekként meghatározott napokat jelenti.

Kezdeti Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Érték vagy **MER Kezdeti Érték:** a Mögöttes Eszköz tekintetében a Mögöttes Eszköznek a Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Megütési Napon alkalmazandó záraskori értékét jelenti.

Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Megütési Nap: 2024. július 5., kiigazítások függvényében.

Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Érték	Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Korlát Megfigyelési Nap	Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Összeg	Kötelező Lejárati Előtti Visszaváltási Nap
a Mögöttes Eszköz MER Kezdeti Értékének 100,00%-a	2025. július 7.	1.072,50 EUR	2025. július 14.
a Mögöttes Eszköz MER Kezdeti Értékének 100,00%-a	2026. július 6.	1.145 EUR	2026. július 13.
a Mögöttes Eszköz MER Kezdeti Értékének 100,00%-a	2027. július 5.	1.217,50 EUR	2027. július 12.

Visszaváltási Összeg: Feltéve hogy az Értékpapírok megelőző visszaváltására, megvásárlására vagy törlésére nem került sor, amennyiben:

- (a) nem következett be Visszaváltási Korlát Esemény, a Kibocsátó a Lejárati Napon 1.290 EUR összegben visszavált minden egyes Értékpapírt; vagy
- (b) Visszaváltási Korlát Esemény következett be és amennyiben:
 - (i) Alsó Visszaváltási Korlát Esemény nem következett be, a Kibocsátó a Lejárati Napon 1.000 EUR összegben visszavált minden egyes Értékpapírt; vagy
 - (ii) Alsó Visszaváltási Korlát Esemény következett be, a Kibocsátó a Lejárati Napon valamennyi Értékpapír tekintetében a (a) Számítási Összeg és a (b) 100% plusz a Mögöttes Eszköz Végső Teljesítménye szorzatának megfelelő összegben visszavált minden egyes Értékpapírt. Képletben kifejezve:

$$CA \times (100,00\% + \text{Mögöttes Eszköz Végső teljesítménye})$$

A fentiek alkalmazásában:

Számítási Összeg vagy **CA:** 1.000 EUR.

Végső Korlát Érték: a Mögöttes Eszköz Kezdeti Visszaváltási Értékének 100,00%-a.

Végső Teljesítmény: a Mögöttes Eszköz tekintetében azt a százalékban kifejezett összeget jelenti, amely megegyezik a Mögöttes Eszköz Végső Visszaváltási Referencia Értéke és a Visszaváltási Megütési Értéke különbözetének valamint a Kezdeti Visszaváltási Érték hányadosával. Képletben kifejezve:

$$\frac{\text{Végső Visszaváltási Referencia Érték} - \text{Visszaváltási Megütési Érték}}{\text{Kezdeti Visszaváltási Érték}}$$

Végső Referencia Érték: a Mögöttes Eszköz tekintetében a Mögöttes Eszköznek az adott Végső Visszaváltási Értékelési Napon alkalmazandó záraskori értékét jelenti.

Végső Értékelési Nap(ok): 2028. július 5., kiigazítások függvényében.

Visszaváltási Korlát Esemény: amennyiben a vonatkozó Visszaváltási Korlát Megfigyelési Napon a Mögöttes Eszköz záraskori értéke nem éri el a Mögöttes Eszköz Végső Korlát Értékét.

Visszaváltási Korlát Megfigyelési Nap: 2028. július 5., kiigazítások függvényében.

Visszaváltási Kezdeti Érték: a Mögöttes Eszköz tekintetében, a Mögöttes Eszköznek a Visszaváltási Megütési Napon alkalmazandó értékét jelenti.

Visszaváltási Alsó Korlát Esemény: amennyiben a vonatkozó Visszaváltási Alsó Korlát Esemény Értékelési Napon a Mögöttes Eszköz záraskori értéke nem éri el a Visszaváltási Alsó Korlát Százalékos Értékét.

Visszaváltási Alsó Korlát Esemény Értékelési Nap: 2028. július 5., kiigazítások függvényében.

Visszaváltási Alsó Korlát Százalékos Érték: a Mögöttes Eszköz Kezdeti Visszaváltási Értékének 65,00%-a.

Visszaváltási Megütési Nap: 2024. július 5., kiigazítások függvényében.

Visszaváltási Megütési Érték: a Mögöttes Eszköz tekintetében a Mögöttes Eszköznek a Visszaváltási Kezdeti Értéke.

A Mögöttes Eszköz(ök)	
Elnevezés	Mögöttes Eszköz a kamatra vonatkozó rendelkezések szempontjából
EURO STOXX® Utilities Price EUR Index (ISIN: EU0009658582)	Bloomberg Page: SX6E <Index>

Lejárat Előtti Visszaváltás:

Bizonyos események vagy körülmények bekövetkezése esetén (ideértve például a Mögöttes Eszköz(ök)re vagy a Kibocsátó fedezeti megállapodásaira kiható eseményeket, a szerződésszegési eseményeket, valamint az adózást és a jogellenességet érintő körülményeket) sor kerülhet az Értékpapíroknak a számítási ügynök által az Értékpapírfeltételekkel összhangban meghatározandó összegben történő lejárat előtti visszaváltására.

Kiigazítások: Az Értékpapírfeltételek tartalmaznak bizonyos rendelkezéseket, ideértve például a Mögöttes Eszköz(ök)re vagy a Kibocsátó fedezeti megállapodásaira kiható eseményekre, az elszámolási zavarokra, a Mögöttes Eszköz piacán felmerülő likviditás hiányára vonatkozó rendelkezéseket, továbbá a piaci zavarokra vonatkozó rendelkezéseket, valamint a Mögöttes Eszköz(ök) árában bekövetkezett utólagos helyesbítésekre vonatkozó rendelkezéseket és ezen rendelkezések következményeinek a részleteit. Ezen rendelkezések adott esetben lehetőséget biztosítanak az Értékpapírfeltételekkel kapcsolatos kiigazítások megtételére. Emellett az Értékpapírfeltételek megengedhetik a nem Munkanapokra eső kifizetési napok kiigazítását is.

Értékpapírtulajdonosi Gyűlések: A tulajdonosok érdekeire általában véve befolyással lévő ügyek megtárgyalása céljából az Értékpapírfeltételek tulajdonosi gyűlések megtartására vonatkozó rendelkezéseket tartalmaznak. Ezen rendelkezések lehetővé teszik, hogy egy előre meghatározott többség valamennyi tulajdonos tekintetében – ideértve az adott gyűlésen részt nem vevő és nem szavazó tulajdonosokat, valamint a döntéseket ellenző tulajdonosokat is – kötelező érvényű döntéseket hozzon.

Alkalmazandó jog: Az Értékpapírok tekintetében alkalmazandó jog az angol jog.

Hitelezői feltőkésítés: A hitelezői feltőkésítést célzó intézkedések alkalmazása vagy az adott szanalási hatóság által a Garanciavállaló tekintetében tett bármely egyéb intézkedés lényegesen hátrányos hatással lehet az Értékpapírok értékére és hozamára.

Értékpapírok státusza: Az Értékpapírok a Kibocsátó közvetlen, feltétel nélküli, alá nem rendelt és nem biztosított kötelezettségeit képezik és egymással, valamint a Kibocsátó más egyéb meglévő vagy jövőbeli közvetlen, feltételhez nem kötött és alá nem rendelt kötelezettségeivel szemben – ide nem értve a kötelezően alkalmazandó és általános hatályú jogszabályok alapján előnyösebben rangsorolt kötelezettségeket – legalább azonos ranghelyen (ún. *pari passu*) rangsoroltak.

Az Értékpapírok szabad átruházhatóságával kapcsolatos korlátozások

Az Értékpapírok – a forgalomba hozataluk szerinti országokban alkalmazandó, forgalomba hozatal és átruházást érintő jogszabályi korlátozások függvényében – szabadon átruházhatóak.

Hol kerül sor az Értékpapírok kereskedésére?

A Kibocsátó (vagy a nevében eljáró személy) kezdeményezni fogja az Értékpapíroknak a Luxemburgi Értéktőzsde Szabályozott Piacára történő bevezetését és a Luxemburgi Értéktőzsde hivatalos kereskedési listájára a kibocsátási naptól – vagy akörüli naptól – kezdődő hatályal történő felvételét.

Milyen garanciát tartalmaznak az Értékpapírok?

A Garanciavállaló rövid bemutatása: A CGML egy zártkörűen működő részvénytársaság, amely Anglia és Wales joga alapján került bejegyzésre 1983. október 21.-én és amelynek a székhelye Angliában a Citigroup Centre, Canada Square, Canary Wharf, London E14 5LB alatt található és a telefonszáma +44 (0)207 986 4000. A CGML cégbírósági nyilvántartási száma 01763297 és a LEI kódja XKZZ2JZF41MRHTR1V493. A CGML a Citigroup Inc. 100%-os leányvállalata és forgalmazóként, árjegyzőként és jegyzési garanciavállalóként, valamint számos nagyvállalati, intézményi és állami ügyfelek részére tanácsadási szolgáltatásokat nyújtó céggé vált nagy nemzetközi jelenléttel bír.

A garancia természete és hatálya: Az Értékpapírok a CGML feltétel nélküli és visszavonhatatlan garanciavállalási nyilatkozata mellett kerülnek kibocsátásra. A garanciavállalás a CGML közvetlen, feltétel nélküli, alá nem rendelt és nem biztosított kötelezettségeit képezik és a CGML más egyéb meglévő vagy jövőbeli nem biztosított és alá nem rendelt kötelezettségeivel

szemben – ide nem értve a kötelezően alkalmazandó és általános hatályú jogszabályok alapján előnyösebben rangsorolt kötelezettségeket – legalább azonos ranghelyen (ún. *pari passu*) rangsoroltak.

A Garanciavállalóval kapcsolatos kiemelt pénzügyi információk: Az alábbi kiemelt pénzügyi információ a Garanciavállalónak a 2023. december 31.-ével és 2022. december 31.-ével lezárt évekre vonatkozó auditált, nem konszolidált éves beszámolóból került beillesztésre.

Összevont információk – Eredménykimutatás		
	2023. december 31.-ével lezárt év (auditált)	2022. december 31.-ével lezárt év (auditált)
Jövedelemadó előtti nyereség (ezer amerikai dollárban)	190	278
Összevont információk – mérleg		
	2023. december 31. (auditált)	2022. december 31. (auditált)
Nettó pénzügyi adósság (hosszú távú adósság plusz rövid távú adósság mínusz készpénz) (ezer amerikai dollárban)	6.460	14.668
Részvénytökhöz viszonyított adósság mutató (összes kötelezettség / összes részvényesi tőke)	16,2	15,7
Összevont információk – cash flow kimutatás		
	2023. december 31.-ével lezárt év (auditált)	2022. december 31.-ével lezárt év (auditált)
Működési tevékenységből származó nettó cash flow (ezer amerikai dollárban)	724	(2.689)
Finanszírozásból származó nettó cash flow (ezer amerikai dollárban)	653	2.237
Befektetésekből származó nettó cash flow (ezer amerikai dollárban)	(1.095)	(586)

A múltbéli pénzügyi tájékoztatással kapcsolatos könyvvizsgálói jelentésben tett záradékok: A Garanciavállaló auditált múltbéli pénzügyi információi tekintetében a könyvvizsgáló nem tett záradékot.

Garanciavállalóra vonatkozó kiemelt kockázati tényezők: A Garanciavállalóra vonatkozó kiemelt kockázati tényezők a következők:

- A Garanciavállaló koncentrált kockázatoknak – ideértve a hitelezési és piaci kockázatokat – van kitéve. Tekintettel arra, hogy a szabályozói és piaci fejlemények a kereskedési tevékenységek növekvő központosítása irányába mutatnak, a Garanciavállaló a kockázatok koncentrációjának a növekedését tapasztalhatja, amely korlátozhatja a fedezeti stratégiáinak a hatékonyságát és a Garanciavállalónak jelentős veszteségeket okozhat. A Garanciavállalóra hatással lehetnek a makrogazdasági, geopolitikai és egyéb kihívások, bizonytalanságok és volatilitások, ideértve a COVID-19 világméretű járványt és Oroszországnak az Ukrajnában lévő katonai tevékenységét (valamint az ezzel kapcsolatos szankciókat, export korlátozásokat és hasonló intézkedéseket és jogszabályokat), amelyek kihathatnak a Garanciavállaló üzleti tevékenységeire és az Értékpapírokkal kapcsolatos kötelezettségeinek a teljesítésére, továbbá az Értékpapírok értékére és az Értékpapírokon elérhető hozamra.
- Előfordulhat, hogy a Garanciavállaló nem lesz képes fenntartani a jelenlegi hitelminősítéseit. Amennyiben egy hitelminősítő csökkenti, felfüggeszti, vagy visszavonja a Garanciavállaló és/vagy a Garanciavállaló valamely kapcsolt vállalkozása tekintetében adott hitelminősítését, ez valószínűsíthetően hátrányos befolyással lehet az Értékpapírok likviditására és piaci értékére. Az esetleges leminősítések negatív hatással lehetnek az egyéb finanszírozási forrásokra, ideértve a biztosított finanszírozást és az egyéb biztosítéknyújtási követelményeket amelyek tekintetében nincsenek kifejezett kiváltó okok.
- Amennyiben az adott szanalási hatóság meggyőződik arról, hogy a Garanciavállaló fizetéseképtelen vagy valószínűleg fizetéseképtelenné fog válni – valamint egyéb feltételek ezzel egyidejű megvalósulása esetén – a Garanciavállaló ellen a szanalási hatóság intézkedést alkalmazhat, ideértve a Garanciavállaló nem biztosított hitelezői követeléseinek (ideértve különösen a garanciavállalás alatti követeléseket) a leírását, továbbá a biztosítatlan hitelkövetelések (ideértve különösen a garanciavállalás alatti követeléseket) más instrumentumokká (pl. részvényekké) történő átalakítását, a garanciavállaló üzletágainak vagy azok egy részének egy másik társaságra történő átruházását vagy az egyéb szanalási intézkedéseket. Az ilyen intézkedések eredményeképpen a befektetők részben vagy teljes mértékben elveszíthetik az Értékpapírokba eszközölt befektetéseiket.

Melyek az Értékpapírokra jellemző sajátos kiemelt kockázati tényezők?

Az Értékpapírokra vonatkozó kiemelt kockázati tényezők a következők:

- Felhívjuk az Ön figyelmét, hogy Ön az Értékpapírok vételárát teljes mértékben vagy részben elveszítheti. Az Értékpapírok lejáratkori visszaváltását megelőző értékét több egymással összefüggő tényező is befolyásolhatja, ideértve a Mögöttes Eszköz(ök) értékét, osztlékhozamát és volatilitását, a közbenső kamatlábak változásait, valamint adott esetben az eredeti vételárhoz képest jelentős diszkont kerülhet alkalmazásra az Értékpapírok lejáratot megelőző értékesítésénél és ennél fogva fennáll az Ön befektetésének teljes mértékű vagy részbeni elvesztésének a kockázata. Amennyiben lejáratkor Visszaváltási Korlát Esemény és Visszaváltási Alsó Korlát Esemény következett be, akkor az Értékpapírok visszaváltásánál Ön a kezdeti befektetésénél kisebb összegben részesülhet, illetve az is előfordulhat, hogy Ön nem részesül kifizetésben. A fentiek mellett az Értékpapírok tekintetében Ön nem részesül kamatkifizetésben.
- A Kibocsátónak az Értékpapírok alapján fennálló kötelezettségei és a Garanciavállalónak a garancianyilatkozat alapján fennálló kötelezettségei az adott személyek – és nem egyéb személyek – általános jellegű szerződéses kötelezettségei. Ennek megfelelően az Értékpapírokkal kapcsolatos kifizetések és eszközök leszállítása a Kibocsátóval és a Garanciavállalóval kapcsolatos hitelezési kockázatainak vannak kitéve. Amennyiben a Kibocsátó vagy a Garanciavállaló nem lesznek képesek az Értékpapírokkal kapcsolatos kötelezettségeiknek a teljesítésére – különös tekintettel a fizetéseképtelenség esetére – akkor az Értékpapírtulajdonosok nem tarthatnak igényt a Kibocsátó vagy a Garanciavállaló biztosított eszközeire, és ennél fogva fennáll a befektetésük teljes mértékű vagy részbeni elvesztésének a kockázata.
- Előfordulhat, hogy az Értékpapírok kibocsátásakor az Értékpapíroknak nem lesz kialakult piaca, továbbá lehetséges, hogy ilyen piac később sem fog kialakulni. Ennek megfelelően a befektetőknek fel kell készülniük arra, hogy az Értékpapírokat lejáratig megtartsák. Amennyiben mégis kialakul ilyen piac, akkor is előfordulhat, hogy a piac nem lesz túl likvid. Ennek megfelelően előfordulhat, hogy Ön nem fogja tudni az Értékpapírokat könnyen értékesíteni vagy egyáltalán nem fogja tudni értékesíteni vagy Ön nem lesz képes az Értékpapírokat az Ön kezdeti befektetésének megfelelő vagy azt meghaladó összegben értékesíteni, továbbá előfordulhat az is, hogy az értékesítési ár lényegesen elmarad az eredeti vételártól. A likviditás hiánya az Értékpapírok piaci értékét lényegesen hátrányosan befolyásolhatja.
- Az Értékpapírok tekintetében fizetendő összegek és leszállítandó eszközök a Mögöttes Eszköz(ök) – azaz egy értékpapír index – teljesítményét követik le. A globális gazdasági, pénzügyi és politikai fejlemények, többek között, jelentős hatással lehetnek a Mögöttes Eszköz(ök) alkotóelemeit képező értékpapírjainak értékére és/vagy a Mögöttes Eszköz(ök) teljesítményére, valamint az elmúlt években a devizaárfolyamok és a Mögöttes Eszköz(ök) alkotóelemeit képező értékpapírok erősen volatilisnak bizonyultak. Ez viszont hatással lehet az Értékpapírok értékére és hozamára. Ha a Mögöttes Eszköz(ök) egy árfolyam-hozam alapú index, az Értékpapírok tulajdonosai nem részesülnek a Mögöttes Eszköz(öke)t alkotó komponensek után fizetett osztlékban, és az ilyen Értékpapírok nem teljesíthetnek olyan jól, mint egy olyan pozíció ahol a tulajdonos közvetlenül fektetett be ezen összetevőkbe vagy ahol a Mögöttes Eszköz(ök) „teljes hozamú” változatába vagy egyéb termékbe fektettek be.
- Az Értékpapírok a Mögöttes Eszközzel kapcsolatos tényleges tulajdonosi jogokat nem testesítenek meg. Az Értékpapír nem testesít meg a Mögöttes Eszközzel kapcsolatos igényt, és amennyiben az Értékpapírok visszaváltásakor kifizetett összeg nem éri el az Ön által befektetett összeget, Ön az Értékpapírok alapján nem lesz jogosult az Értékpapírokkal kapcsolatos Mögöttes Eszköz igénylésére. Önnek nem less tulajdonjoga vagy egyéb jogosultsága a Mögöttes Eszköz vonatkozásában. Előfordulhat, hogy Ön az Értékpapírok vonatkozásában alacsonyabb hozamban részesül, mint amelyet akkor kapna, ha közvetlenül a Mögöttes Eszközbe fektetett volna be vagy egy más terméken keresztül fektetett volna be a Mögöttes Eszközbe.
- Az Értékpapírfeltételek az adott Mögöttes Eszköz tervezett ármeghatározási napjának az elhalasztásával kapcsolatos rendelkezéseket tartalmazhatnak. Az előzőekben említett halasztás lehetősége vagy az Értékpapírfeltételekben foglalt alternatív értékelési rendelkezések hátrányosan befolyásolhatják az Értékpapírok értékét.
- A számítási ügynök jogosult az Értékpapírok feltételeit abból a célból kiigazítani, hogy az Értékpapírok vagy valamely Mögöttes Eszköz és/ vagy a fedezeti megállapodások tekintetében bekövetkező kiigazítási eseményt figyelembe vegye vagy helyettesítse a Mögöttes Eszközt egy új értékpapír indexel. A fenti kiigazítások bármelyike hátrányosan befolyásolhatja az Értékpapírok értékét.
- Bizonyos esetekben az Értékpapírok lejárat előtti visszaváltására kerülhet sor (ideértve például azokat az eseteket amikor – egy szerződészegési eseményt követően vagy a Mögöttes Eszközre vagy a Kibocsátó fedezeti megállapodásaira kiható bizonyos események bekövetkezését követően vagy az adózással vagy lehetetlenüléssel kapcsolatos okokból kifolyólag – a számítási ügynök ésszerű megítélése szerint nem lehetséges számításokat, kiigazításokat vagy helyesbítéseket végezni). Amennyiben az Értékpapírok lejárat előtti visszaváltására kerülne sor, előfordulhat, hogy a kifizetésre kerülő összeg az Ön kezdeti befektetésénél kisebb lesz, amelynek következtében Önt veszteség érheti.
- A Kötelező Lejárat Előtti Visszaváltás Korlát Esemény bekövetkezését követően az Értékpapírok az adott Kötelező Lejárat Előtti Visszaváltási Napon visszaváltásra kerülnek Kötelező Lejárat Előtti Visszaváltási Összegen. A Kötelező Lejárat Előtti Visszaváltási Napot követően az Értékpapírok tekintetében további összegek nem kerülnek kifizetésre. Ebben az esetben Ön ki van téve az újrabefektetési kockázatnak, tekintettel arra, hogy előfordulhat, hogy Ön nem lesz képes az Értékpapírokkal kapcsolatos befektetését egy olyan befektetéssel helyettesíteni amelynek a kockázati profilja hasonlít az Értékpapírok kockázati profiljára.

AZ ÉRTÉKPAPÍROK NYILVÁNOS FORGALOMBA HOZATALÁRA ÉS/VAGY SZABÁLYOZOTT PIACRA TÖRTÉNŐ BEVEZETÉSÉRE TETT AJÁNLATTÉTELRE VONATKOZÓ KIEMELT INFORMÁCIÓ

Milyen feltételek mellett és határidőkkel számolva fektethet be az Értékpapírokba?

A forgalomba hozatal feltételei:

Az Értékpapírok forgalomba hozatalára Magyarországon kerül sor 2024. június 19.-étől (ezt a napot is beleértve) 2024. július 4.-ig. A Kibocsátó jogosult ezen időszak módosítására. Az Értékpapírok magyarországi forgalomba hozatalával kapcsolatos Forgalomba Hozatali Időszak nem lehet rövidebb mint három munkanap. A Kibocsátó fenntartja a jogot az Értékpapírok forgalomba hozatalának törlésére.

A forgalomba hozatali ár 1.000 EUR. A legkisebb jegyzési mennyiség 1 (azaz egy) Értékpapír (amely 1.000 EUR tőkeösszegnek felel meg). A maximum lejegyezhető összeg a jegyzéskor rendelkezésre álló Értékpapírok mennyiségétől függ. A Kibocsátó

jogosult teljes mértékben vagy részben visszautasítani az Értékpapírokkal kapcsolatos jegyzési ajánlatot és/vagy jogosult a maximum darabszámot meghaladó mértékű jegyzési ajánlatokat is elfogadni és a maximum darabszámot megemelni.

A jegyzési folyamat bemutatása: Az Értékpapírok jegyzésével kapcsolatosan az esetleges befektetők Magyarországon a Felhatalmazott Forgalmazó részére nyújthatnak be ajánlatot. A magyarországi lehetséges befektetőknek a Felhatalmazott Forgalmazóval kell leegyeztetniük, hogy a Felhatalmazott Forgalmazó milyen határidőn belül és milyen módon tart igényt az Értékpapírok jegyzés útján történő megvásárlásával kapcsolatosan befizetendő összegeknek a Felhatalmazott Forgalmazó részére történő átadására.

Az Értékpapírok leszállításának és befizetésének módjával és határidejével kapcsolatos részletek: Az Értékpapírok leszállítására fizetés ellenében (*delivery versus payment*) kerül sor. A Kibocsátó várakozása szerint az Értékpapíroknak a vásárlók értékpapírszámláin történő jóváírására a kibocsátási napon vagy akörül kerül sor.

A forgalomba hozatal eredménye nyilvánosságra hozatalának módja és napja: A Kibocsátó által a Luxemburgi Értéktőzse honlapján (www.luxse.com) közzétett értesítés útján kerül sor.

A kibocsátó / Forgalmazó által a befektetőre áthárított költségek és adók becsült összege

A Kibocsátó nem fizet a Szervezőnek jutalékot. A Szervező által a Felhatalmazott Forgalmazó számára fizetendő díj nem haladhatja meg a számítási összeg 1,50%-át. A befektetők a díjak vonatkozásában további információkban részesülhetnek, amennyiben felveszik a kapcsolatot a Felhatalmazott Forgalmazóval.

Ki az ajánlattevő és/vagy a kereskedésre történő bevezetést kérő személy?

Az Értékpapírok bevezetését kezdeményező személy a Kibocsátó.

Felhatalmazott Forgalmazó: A Felhatalmazott Forgalmazó az OTP Bank Nyrt. amelynek székhelye 1051 Budapest, Nádor utca 16. cím alatt található. LEI azonosítója: 529900W3MOO00A18X956. A Felhatalmazott Forgalmazó székhelye Magyarországon található és a Felhatalmazott Forgalmazó Magyarországon, magyar jog szerinti nyilvános részvénytársaságként került nyilvántartásba vételre és a Magyar Nemzeti Bank engedélyével rendelkezik.

Miért készült ez a Tájékoztató?

Nettó bevételek becsült összege és felhasználása: Az Értékpapírok kibocsátásából eredő nettó bevételek elsősorban a CGML vagy az ugyanazon Csoportba tartozó egyéb társaságok részére történő kölcsön vagy egyéb formájú finanszírozás nyújtásának és a Kibocsátó finanszírozásának céljaira kerülnek felhasználásra. A nettó bevételek becsült összege megegyezik az Értékpapíroknak a kibocsátási napon fenálló összesített kibocsátási tőkeösszegével.

Kötelező erejű jegyzési garanciavállalás: Az Értékpapírok forgalomba hozatala tekintetében kötelező erejű jegyzési garanciavállalásra nem került sor.

A kibocsátással/forgalomba hozattal érintett természetes és egyedi személyek érdekeinek a bemutatása, ideértve az esetleges összeegyeztethetlenséget is.

A szervező és/vagy a forgalmazó(k) díjfizetésben részesülnek. Az Értékpapírfeltételek a Kibocsátó, a számítási ügynök valamint egyéb személyek számára az Értékpapírokkal kapcsolatos döntések meghozatala, egyes meghatározások és számítások tekintetében diszkrecionális jogköröket biztosítanak. A Kibocsátó, a számítási ügynök és az Értékpapírok tulajdonosai között nem zárható ki az érdekellentét, ideértve a fent említett döntések meghozatala, egyes meghatározások és számítások tekintetében fennálló érdekellentétet. A Kibocsátó, a CGML és/vagy a kapcsolt vállalkozásaik időről időre az Értékpapírokra hatással lévő vagy azokra vonatkozó saját számlás ügyleteket köthetnek vagy üzleti kapcsolatot tarthatnak fenn és/vagy információkat birtokolhatnak. A Kibocsátó, a CGML és/vagy a kapcsolt vállalkozásaik nem kötelesek ezen információk átadására és – a befektetőknél felmerülő következményektől függetlenül – jogukban áll bármely a megítélésük szerint az érdekeik védelmében szükséges vagy megfelelő jogcselekményt vagy lépést megtenni. A fent részletezettektől eltekintve a Kibocsátónak nincs tudomása arról, hogy bármely az Értékpapírok forgalomba hozatalában közreműködő személynek jelentős érdeke állna fenn a forgalomba hozatalhoz fűződően.