# Document d’Informations Clés

**Objet**

**Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d’investissement. Il ne s’agit pas d’un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d’autres produits.**

**Produit**

**Warrant Call sur ADR Nio, Inc.**

ISIN: DE000KF4PK65

**Producteur du produit: Citigroup Global Markets Europe AG (émetteur)** / www.citifirst.fr

Des informations supplémentaires sont à votre disposition par téléphone au 01 70 75 50 08

L’Autorité Fédérale Allemande de Supervision Financière (Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht « BaFin »), en Allemagne, est responsable de la supervision prudentielle de Citigroup Global Markets Europe AG en ce qui concerne le présent document d’informations clés.

Date de création du Document d’Informations Clés : 6 décembre 2021 à 12:32:44 CET Mise à jour la plus récente du Document d’Informations Clés : 5 janvier 2023 à 09:23:22 CET. (Version 186)

**Vous êtes sur le point d’acquérir un produit qui n’est pas simple et peut être difficile à comprendre.**

## 1. En quoi consiste ce produit?

### Type de produit

Ce produit est une obligation au porteur émise conformément au droit allemand.

### Durée de vie

Ce produit a une date d’échéance déterminée et arrivera à maturité à la date d’échéance.

### Objectifs

L’objectif du produit est de vous conférer certains droits à des conditions déterminées à l’avance. Vous participez de manière amplifiée (avec un effet de levier) à toutes les évolutions des cours du Sous-Jacent.

Les options suivantes sont disponibles pour le remboursement du produit:

(i) Si à la Date d’Evaluation, le Prix de Référence est supérieur au Prix d’Exercice , à la date d’échéance vous recevrez un montant de remboursement qui correspond au montant, multiplié par le Ratio de Multiplication, dont le Prix de Référence est supérieur au Prix d’Exercice. Ce Montant de Remboursement sera converti en euros, à savoir le montant en USD sera divisé par le taux de change EUR/USD.

(ii) Si à la Date d’Evaluation, le Prix de Référence est inférieur ou égal au Prix d’Exercice , alors il n’y aura pas de paiement et le produit expirera sans valeur.

Vous renoncez aux droits aux dividendes du Sous-Jacent et n’avez aucun autre droit découlant du Sous-Jacent (par ex. droits de vote).

| | | | |
|---|---|---|---|
| Sous-Jacent (ISIN) | Action Nio, Inc. (US62914V1061) | Date d’Evaluation | 19 janvier 2023 |
| Devise du Produit | Euro (EUR) | Date d’Echéance | 25 janvier 2023 |
| Devise du Sous-Jacent | USD | Date d’Emission | 7 décembre 2021 |
| Prix d’Emission | EUR 0,49 | Type d’Exercice | Européen (c’est à dire que le produit ne peut être exercé pendant sa durée de vie) |
| Prix d’Exercice | USD 45,00 | Type de Warrant | Call (spéculation sur une hausse des prix) |
| Ratio de Multiplication | 0,1 | Volume minimum d’exercice | 1 Warrant |
| Prix du Sous-Jacent lorsque le produit a été émis | USD 32,15 | Type de dénouement | Paiement en numéraire |
| Prix de Référence | Cours de clôture établi sur la Bourse Applicable Cours de clôture déterminé sur la bourse de référence à la date d’ évaluation | Garantie de change (Quanto) | Non |
| Bourse Applicable | New York Stock Exchange | | |

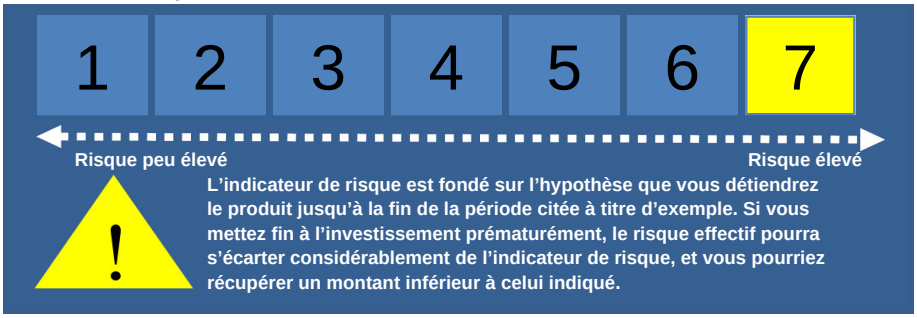
En cas d’événement extraordinaire, l’Emetteur aura le droit de résilier le produit avec effet immédiat. Les événements extraordinaires incluent, sans s’y limiter, la radiation de la cotation ou l’interruption du Sous-Jacent, les modifications de la législation, les événements fiscaux ou l’interruption de la capacité de l’Emetteur de réaliser les opérations de couverture nécessaires. En cas de résiliation, le montant de remboursement pourra être significativement inférieur au prix d’achat. Une perte presque totale de l’ investissement est également possible. En outre, vous supporterez le risque de résiliation à un moment qui vous serait défavorable de sorte que vous ne soyez en mesure de réinvestir le montant de remboursement qu’à des conditions moins favorables.

### Groupe cible des investisseurs de détail

Le produit est destiné à des clients de détail qui poursuivent l’objectif d’une participation disproportionnée aux changements de prix et/ou de couverture contre les risques et qui ont un horizon d’investissement à court-terme. Ce produit est destiné aux investisseurs possédant une connaissance et/ou expérience approfondie des produits financiers. Ces investisseurs sont en mesure de supporter des pertes (pouvant aller jusqu’à la perte totale du capital investi) et n’accordent pas d’importance à la protection du capital.

## 2. Quels sont les risques et qu'est-ce que cela pourrait me rapporter?

### Indicateur de risque




L'indicateur synthétique de risque total est une aide à l'évaluation du risque attaché à ce produit comparé à d'autres produits. Il montre à quel niveau s'élève la possibilité que le produit perde de la valeur en raison de l'évolution du marché ou de notre incapacité à vous rembourser.
Nous avons classé le produit dans la catégorie de risque 7 sur une échelle de 1 à 7, ce qui correspond la classe de risque la plus élevée .
Le risque de pertes potentielles découlant de l'évolution de prix future est classé comme très élevé , et en cas de conditions défavorables du marché, il est extrêmement improbable que notre capacité de vous payer soit affectée.
Ce produit n'inclut pas de protection contre les performances futures du marché, de sorte que vous pourriez perdre tout ou partie de votre capital investi.
Si nous ne sommes pas en mesure de vous verser le montant dû, vous pourrez perdre la totalité de votre capital investi.

### Scenari de performance

**Le rendement final que vous percevrez sur ce produit dépendra de la performance future du marché. La performance future du marché est incertaine et ne peut être prédite avec certitude.**
**Les scenari décrits sont basés sur la performance historique et certaines hypothèses. Il est possible que la performance des marchés soit complètement différente à l'avenir.**

| Période de détention recommandée<br>Exemple d'investissement | | Période d'exemple (1 jour calendaire)<br>10 000 EUR<br>si vous revendez après un 1 jour calendaire |
|---|---|---|
| **Scenari** | | |
| **Rendement minimum** | **Il n'y a pas de rendement minimum garanti. Il est possible que vous subissiez une perte partielle ou totale de votre investissement.** | |
| **Scénario de Stress** | **Que pourriez-vous récupérer finalement après déduction des frais** | **0 EUR** |
| | Rendement en pourcentage (non annualisé) | **-100,0%** |
| **Scénario défavorable** | **Que pourriez-vous récupérer finalement après déduction des frais** | **0 EUR** |
| | Rendement en pourcentage (non annualisé) | **-100,0%** |
| **Scénario médian** | **Que pourriez-vous récupérer finalement après déduction des frais** | **0 EUR** |
| | Rendement en pourcentage (non annualisé) | **-100,0%** |
| **Scénario favorable** | **Que pourriez-vous récupérer finalement après déduction des frais** | **0 EUR** |
| | Rendement en pourcentage (non annualisé) | **-100,0%** |

Les montants indiqués comprennent tous les coûts du produit lui-même mais peuvent ne pas inclure tous les coûts que vous payez à votre conseiller ou à votre distributeur. En outre, votre situation fiscale personnelle, qui peut aussi influer sur le montant de votre remboursement, n'est pas prise en compte.
Le scénario de stress montre le montant que vous pourriez possiblement récupérer dans des conditions de marché extrêmes.
Les scenari présentés montrent des résultats potentiels dont le calcul est basé sur des simulations sous-jacentes.

## 3. Que se passe-t-il si Citigroup Global Markets Europe AG n'est pas en mesure d'effectuer les versements?

Vous êtes exposé au risque que l'Emetteur ne soit pas en mesure de remplir ses obligations découlant du produit, par exemple, en cas d'insolvabilité (incapacité de payer les dettes à leur échéance/surendettement) ou de décisions administratives de mesures de résolution. Si l'Emetteur traverse une crise, une telle décision administrative pourra être prise par une Autorité de Résolution avant l'ouverture d'une procédure d'insolvabilité. Dans ce contexte, une Autorité de Résolution dispose de compétences d'intervention étendues. Celles-ci incluent, sans limitation, le pouvoir de réduire les créances des investisseurs à zéro, résilier le produit ou le convertir en actions de l'émetteur et suspendre les droits de l'investisseur. Une perte totale du capital investi est possible. En sa qualité de produit de dette, le produit ne fait l'objet d'aucune protection des dépôts.

## 4. Que va me coûter cet investissement?

La personne qui vous vend ou vous conseille ce produit peut vous facturer des frais supplémentaires. Si tel est le cas, cette personne vous donnera des informations relatives à ces frais et vous montrera l'impact de ces frais sur votre investissement au fil du temps.

### Coûts au fil du temps

Les tableaux présentent les montants qui seront prélevés sur votre investissement afin de couvrir différents types de frais. Ces frais dépendent du montant de votre investissement et de la durée de détention du produit. Les chiffres présentés ci-dessous sont un exemple d'un montant investi et de différentes périodes d'investissement possibles.
Nous les avons fondés sur les hypothèses suivantes:

— Vous récupéreriez le montant investi (rendement annuel de 0 %).
— Un montant de 10 000 EUR est investi.

| | Si vous revendez à la fin de la période d'exemple (1 jour calendaire) |
|---|---|
| **Frais totaux** | **9 677 EUR** |
| Impact des frais* | 3 000,0% |

* Ces chiffres illustrent l'impact des frais pour une période de détention inférieure à un an. Ce pourcentage sera déterminé sur la base des frais cumulés pendant la période concernée divisés par le montant investi, et ne pourra pas être comparé directement aux chiffres relatifs à l'impact des frais d'autres produits.

### Composition des frais

| **Coûts ponctuels en cas d'entrée ou de sortie** | | Si vous revendez après 1 jour calendaire: |
|---|---|---|
| **Coûts d'entrée** | Ces frais sont inclus dans le prix que vous payez. | **9 677 EUR** |
| **Coûts de sortie** | Ces frais sont inclus dans le prix que vous recevez et ne serons applicables que si vous sortez avant l'échéance. Si vous conservez le produit jusqu'à l'échéance, les frais de sortie ne seront pas encourus. | **0 EUR** |

## 5. Combien de temps dois-je le conserver l'investissement et puis-je retirer l'argent de manière anticipée?

### Période de détention recommandée: 1 jour de calendaire (période par exemple)

Il n'est pas possible de faire de recommandation individuelle concernant la période de détention. En raison de l'effet de levier, le produit sera affecté par le moindre changement de prix du Sous-Jacent, ce qui rend les périodes de réalisation des profits et pertes imprévisibles. Toute recommandation individuelle concernant une période de détention spécifique reviendrait à fournir une information trompeuse aux investisseurs spéculatifs. Pour les investisseurs qui achètent le produit à des fins de couverture, la période de détention dépendra de l'horizon de couverture de chaque investisseur individuel.

Il n'existe aucun moyen pour vous de retirer de l'argent avant l'échéance, si ce n'est en vendant le produit sur la bourse où il est coté ou par une vente hors marché. Si vous vendez le produit avant la fin de la période de détention recommandée, le montant que vous recevrez pourra être - parfois de manière significative - inférieur au montant que vous auriez reçu autrement.

| | | | |
|---|---|---|---|
| Admission à la cote | Euronext Access | Dernier jour de cotation | 18 janvier 2023 |
| Unité minimale négociable | 1 Warrant | Cotation | Cotation en unités |

Dans des situations de marché exceptionnelles ou en cas de dysfonctionnements, l'achat ou la vente du produit pourront être provisoirement rendus difficiles ou impossibles.

## 6. Comment puis-je faire une réclamation?

Toutes réclamations au sujet de la personne qui vend ou conseille le présent produit peuvent être adressées directement à cette personne par le biais du site Internet concerné.

Les réclamations concernant le produit ou le comportement de l'émetteur du produit peuvent être adressées par écrit à l'adresse suivante: Citigroup Global Markets Europe AG ; CitiFirst - Warrants & Certificats ; 25 rue Balzac 75008 Paris ou par courriel à l'adresse suivante: warrants.france@citi.com.

## 7. Autres informations pertinentes

Le Prospectus, y compris tout supplément et les Conditions Définitives, seront publiés conformément aux exigences légales sur le site internet de l'Emetteur (www.citifirst.com; le Prospectus et les suppléments étant disponibles sous la rubrique « Produits – Documentation légale » ; les Conditions Définitives sous la rubrique « Documentation » après la saisie de l'ISIN ou https://fr.citifirst.com/finalterms/DE000KF4PK65). Afin d'obtenir des informations plus détaillées, en particulier sur la structure et les risques attachés à un investissement dans ce produit, vous devez lire ces documents.