

Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 002P-03-IMOEX_CALL_SPREAD

1. В случае если не выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода (как оно определено в пп. 3. ниже):

$$\text{ДД (в \%)} = \min[\max\{(\text{БА}_{\text{фин}} / \text{БА}_{\text{нач}} - 1); 0\}; (\text{БА}_{\text{бар}} / \text{БА}_{\text{нач}} - 1)] * K * 100\%$$

где:

ДД (%) – размер дополнительного дохода, в процентах;

max – функция максимального значения указанных переменных;

min – функция минимального значения указанных переменных;

БА_{нач} – значение Базового актива на дату размещения Биржевых облигаций, в пунктах;

БА_{фин} – значение Базового актива на Дату определения значения Базового актива, в пунктах;

БА_{бар} – Барьерное значение Базового актива, равное **БА_{нач}*1,2**, в пунктах;

K – коэффициент участия, равный **1**.

Дополнительный доход в процентах рассчитывается с точностью до пятого знака после запятой (округление пятого знака после запятой производится по правилам математического округления: в случае, если шестой знак после запятой больше или равен 5, пятый знак после запятой увеличивается на единицу, в случае, если шестой знак после запятой меньше 5, пятый знак после запятой не изменяется).

В случае если выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, как оно определено в пп. 3 ниже, либо в случае досрочного погашения Биржевых облигаций:

$$\text{ДД (\%)} = 0,00\%.$$

2. **Базовый актив** – значение «Индекса МосБиржи» (ISIN: RU000A0JP7K5), рассчитываемое Биржей в соответствии с Методикой расчетов Индексов Московской Биржи, публикуемое на странице в сети Интернет <https://www.moex.com/ru/index/IMOEX/archive> (поле «Закрытие») (или иная страница в сети Интернет, используемая Московской биржей для раскрытия данной информации).

Дата определения значения Базового актива:

А) 3-ий рабочий день, предшествующий дате погашения Биржевых облигаций (в случае, если в указанную дату значение Базового актива может быть определено в соответствии с положениями настоящего пп.2 выше).

Б) Если на Дату определения значения Базового актива, указанную в п. (А), значение Базового актива не опубликовано на странице в сети Интернет, на которой публикуется такое значение в соответствии с положениями настоящего пп.2 выше, или указанная страница в сети Интернет недоступна, или по любым иным причинам невозможно получить информацию о таком значении на указанной странице в сети Интернет, то Датой определения значения Базового актива является последовательно 4-ый, 5-ый, 6-ой, ..., (n-1)-ый, n-ый рабочий день (заканчивая датой начала размещения), предшествующий дате погашения Биржевых облигаций (т.е. последовательно проводится определение значения Базового актива в указанные даты до тех пор, пока значение Базового актива не будет определено).

В случае если значение Базового актива не может быть определено в указанные даты в соответствии с положениями настоящего пп.2, то считается, что для расчета дополнительного дохода выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, как оно определено ниже.

3. **Условие невыплаты дополнительного дохода** – значение Базового актива в Дату определения значения Базового актива (**БА_{фин}**) не может быть определено в соответствии с положениями пп.2 выше.

4. Порядок расчета суммы дополнительного дохода, подлежащего выплате на одну Биржевую облигацию (в рублях):

$$\text{ДД (руб)} = \text{ДД (\%)} * N$$

где:

ДД (%) – размер дополнительного дохода, рассчитанный в порядке, указанном выше, в процентах;

N – номинальная стоимость одной Биржевой облигации, равная 1 000 рублей.

Дополнительный доход в рублях Российской Федерации, подлежащий выплате на одну Биржевую облигацию, рассчитывается с точностью до второго знака после запятой (округление цифр при расчете дополнительного дохода в валюте номинала производится по правилам математического округления. При этом под правилом математического округления следует понимать метод округления, при котором в случае, если третий знак после запятой больше или равен 5, второй знак после запятой увеличивается на единицу, в случае, если третий знак после запятой меньше 5, второй знак после запятой не изменяется).