



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 002P-09-BRENT_CALL_SPREAD

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

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

где:

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

max – функция максимального значения указанных переменных;

min – функция минимального значения указанных переменных;

БА_{нач} – значение рыночной цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив на 18-30 по Московскому времени 15.07.2019 (дата размещения Биржевых облигаций), в долларах США;

БА_{фин} – значение Применимой цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив на Дату определения, в долларах США;

БА_{бар} – Барьерное значение, равное **БА_{нач} * 1,20**, в долларах США;

USDRUB_{нач} – курс доллара США к рублю РФ, установленный Центральным Банком Российской Федерации на следующий после Даты размещения Биржевых облигаций рабочий день;

USDRUB_{фин} – курс доллара США к рублю РФ, установленный Центральным Банком Российской Федерации на следующий после Даты определения рабочий день;

K – коэффициент участия, равный **0,7**.

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:

$$\text{ДД (\%)} = 0,00\%.$$

Базовый актив – смесь сырой нефти марки «Брент» (Brent Crude Oil).

Активный фьючерсный контракт – фьючерсный контракт с ближайшей датой исполнения (expiration date) к Дате определения. Если же в отношении такого контракта наступил последний день, когда по нему проводились торги на ICE Futures Europe, то в качестве Активного фьючерсного контракта принимается фьючерсный контракт на Базовый актив со следующей (второй) ближайшей датой исполнения (expiration date) к Дате определения.

Применимая цена – официальная расчетная цена (settle price), в долларах США, публикуемая ICE Futures Europe в ежедневном отчете рынка фьючерсов (Futures Daily Market Report for ICE Brent Futures), округлённая до двух знаков после запятой (округление производится по правилам математического округления, а именно: 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).

Источник публикации рыночной цены Активного фьючерсного контракта –



ICE Futures Europe

(<https://www.theice.com/products/219/Brent-Crude-Futures/data?marketId=222465>).

Источник публикации Применимой цены Активного фьючерсного контракта –

ICE Futures Europe

(<https://www.theice.com/marketdata/reports/10/product/254/hub/403/isOption/false/isSpread/false>).

2. Дата определения:

А) 2-ий рабочий день, предшествующий дате погашения Биржевых облигаций (в случае, если в указанную дату значение Применимой цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив может быть определено в соответствии с положениями настоящего пп.1 п.(Б) выше).

Б) Если на Дату определения, указанную в п. (А), значение Применимой цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив не опубликовано ICE Futures Europe в ежедневном отчете рынка фьючерсов (Futures Daily Market Report for ICE Brent Futures) в соответствии с положениями настоящего пп.1 п. (Б) выше или по любым иным причинам невозможно получить информацию о таком значении, то Датой определения является последовательно 3-ий, 4-ый, 5-ой, ..., (n-1)-ый, n-ый рабочий день (заканчивая датой начала размещения), предшествующий дате погашения Биржевых облигаций (т.е. последовательно проводится определение значения Применимой цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив в указанные даты до тех пор, пока значение Применимой цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив не будет определено)

В случае если значение Применимой цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив 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 Применимой цены Активного фьючерсного контракта на Базовый актив в Дату определения 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).