

**ГАЗПРОМБАНК**

**Предварительные параметры выпуска биржевых облигаций
Банка ГПБ (АО) с дополнительным доходом
серии 002P-10-XAUUSD_RANGE_ACCRUAL**

Эмитент	«Газпромбанк» (Акционерное общество)
Кредитный рейтинг эмитента	Ba1 (Moody's)/ BB+ (S&P)/ BBB- (Fitch)/ AA(RU) (АКРА)
Идентификационный номер Программы облигаций	400354B002P02E от 16.04.2018
Идентификационный номер выпуска облигаций	4B021000354B002P
Серия облигаций	002P-10- XAUUSD_RANGE_ACCRUAL
Кредитный рейтинг бумаги	отсутствует
Номинальная стоимость	1 000 рублей
Объем выпуска	500 000 000 рублей
Срок обращения	182 дня
Оферта	отсутствует
Купонный период	182 дня
Гарантированный доход	0,01% годовых
Дополнительный доход	Предусматривается выплата дополнительного дохода в соответствии с формулой, приведенной в приложении
Способ размещения	Букбилдинг
Сбор предварительных заявок	Период сбора предварительных заявок: с 19.09.2019 по 27.09.2019 Дата активации (удовлетворения) предварительных заявок: 30.09.2019 (равна дате начала размещения) Сбор предварительных заявок происходит на Бирже в режиме «Размещение: Адресные заявки»
Предварительная дата начала размещения и метод проведения расчетов	30.09.2019 ПАО Московская Биржа - режим «Размещение: Адресные заявки»
Предварительный регламент размещения на Бирже в дату размещения	Основная сессия: - период сбора основных заявок: 10:00 – 16:00 - период удовлетворения основных заявок: 16:30 – 17:29 Дополнительная сессия: - период сбора и удовлетворения основных заявок: с момента окончания перерыва на клиринговую сессию НКЦ до 18:30
Цена размещения	100% от номинала
Листинг	3 уровень
Организатор	«Газпромбанк» (Акционерное общество)
Агент по размещению	«Газпромбанк» (Акционерное общество)
Депозитарий облигаций	НКО АО НРД



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 002P-10-XAUUSD_RANGE_ACCRUAL

1. В случае если не выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода (как оно определено в пп. 2. ниже):

$$\text{ДД (в \%)} = K * d/D * 100\%$$

где:

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

K – параметр, равный **0,065**;

d – количество Торговых дней в течение Периода наблюдения, в которые значение Базового актива находилось в Диапазоне целевых значений;

D – количество всех Торговых дней в течение Периода наблюдения.

Торговый день – день, в который определяется или должно определяться значение Базового актива в соответствии с правилами, установленными расчетным администратором Межконтинентальной биржи (ICE Benchmark Administration) и публикуемыми на сайте Межконтинентальной биржи (ICE) <http://www.theice.com/iba/lbma-gold-silver-price>.

Период наблюдения – с **30.09.2019** (включительно) по **25.03.2020** (включительно).

Базовый актив – Утренний фиксинг цены на золото (ежедневное определение цены на золото публикуемое в 10:30 по Гринвичу или около этого времени) в долларах США за тройскую унцию, определяемый расчетным администратором Межконтинентальной биржи (ICE Benchmark Administration) в соответствии с правилами, публикуемыми на сайте Межконтинентальной биржи (ICE) <http://www.theice.com/iba/lbma-gold-silver-price>, и публикуемый на сайте Лондонской ассоциации рынка драгоценных металлов (London Bullion Market Association) в соответствующем разделе USD AM <http://www.lbma.org.uk/precious-metal-prices>, округлённый 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).

Диапазон целевых значений – диапазон значений Базового актива, начиная со значения Базового актива на **30.09.2019** (включительно) (далее - **Р_{нач}**) и до значения, определяемого по формуле и равного **1,07*Р_{нач}** (включительно). Все значения при определении Диапазона целевых значений округляются 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).

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. 2 ниже, либо в случае досрочного погашения Биржевых облигаций:

$$\text{ДД (\%)} = 0,00\%.$$



2. **Условие невыплаты дополнительного дохода** выполняется в случае, если одновременно не выполняются следующие условия:

- а. Значение Базового актива может быть определено в каждую дату Периода наблюдения;
- б. Существует как минимум одна дата в Периоде наблюдения, когда значение Базового актива находилось в Диапазоне целевых значений.

3. 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).



НАСТОЯЩЕЕ СООБЩЕНИЕ И ДОКУМЕНТЫ, ПРЕДСТАВЛЕННЫЕ ВАШЕМУ ВНИМАНИЮ, НЕ ЯВЛЯЮТСЯ ПРЕДЛОЖЕНИЕМ О ПРОДАЖЕ КАКИХ-ЛИБО ЦЕННЫХ БУМАГ, НЕ ЯВЛЯЮТСЯ ИНДИВИДУАЛЬНОЙ ИНВЕСТИЦИОННОЙ РЕКОМЕНДАЦИЕЙ И НЕ ПРЕДНАЗНАЧЕНЫ ДЛЯ ОЗНАКОМЛЕНИЯ ИЛИ ДОСТУПА ЛИЦАМ, НАХОДЯЩИМСЯ В ЕВРОПЕЙСКОМ СОЮЗЕ, СОЕДИНЕННЫХ ШТАТАХ АМЕРИКИ, АВСТРАЛИИ, КАНАДЕ ИЛИ ЯПОНИИ.

«Газпромбанк» (Акционерное общество) (далее – Эмитент) настоящим не делает предложения о продаже каких-либо ценных бумаг и не осуществляет действий, направленных на получение предложения о покупке каких-либо ценных бумаг в отношении любых лиц, находящихся в любой юрисдикции. Настоящее сообщение и документы, представленные Вашему вниманию, не могут быть использованы для или в связи с подготовкой любого сообщения в любых юрисдикциях или при любых обстоятельствах, в/при которых такое подготовленное сообщение будет считаться недопустимым или незаконным. Эмитент требует от каждого лица, которое получает доступ к настоящему сообщению и документам, изучить и соблюдать такие ограничения. Документы, представленные для Вашего ознакомления, носят исключительно информационный характер и не являются рекламой или предложением о продаже каких-либо ценных бумаг в любой стране.

Настоящее сообщение и сопутствующие документы, не являются индивидуальной инвестиционной рекомендацией в соответствии с Федеральным законом от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг». Финансовые инструменты, сделки с ними, упомянутые в сообщении и документах, могут не соответствовать Вашему инвестиционному профилю. Соответствие финансового инструмента либо сделки с ним инвестиционным целям, инвестиционному горизонту и отношению к риску определяется инвестором самостоятельно. «Газпромбанк» (Акционерное общество) не несет ответственности за возможные убытки инвестора в случае совершения или не совершения сделки с финансовыми инструментами, упомянутыми в сообщении и документах, использования иным образом информации, содержащейся в сообщении и документах.

ВЛАДЕНИЕ БИРЖЕВЫМИ ОБЛИГАЦИЯМИ ИЛИ ДРУГИМИ ФИНАНСОВЫМИ ИНСТРУМЕНТАМИ ВСЕГДА СВЯЗАНО С РИСКАМИ. Настоящее сообщение носит исключительно информационный характер и содержит очень ограниченную информацию об инвестировании в ценные бумаги Эмитента. Такому инвестированию должно предшествовать взвешенное решение, основанное, среди прочего, на тщательном анализе Эмитента, его аффилированных лиц, операций, финансового состояния, продаж и доходов, состояния российской экономики в целом и других риск-факторов.

Перед заключением любых сделок, связанных с инвестированием в биржевые облигации Эмитента, инвестор должен оценить экономические риски и выгоды, а также юридические и налоговые последствия таких сделок, не полагаясь на мнение работников Эмитента и/или его дочерних и аффилированных структур.

При приобретении биржевых облигаций с дополнительным доходом, размещаемых в рамках Программы биржевых облигаций серии 002Р (далее – Индексные облигации) помимо общих рисков, связанных с операциями на рынке ценных бумаг, существуют следующие риски, которые могут повлечь существенные финансовые потери:

Политические, экономические, валютные и кредитные риски стран местонахождения Эмитента Индексных облигаций, а также страны местонахождения эмитентов ценных бумаг, составляющих инвестиционную корзину или базовый актив Индексной облигации (далее – Базовый актив), лежащих в ее основе, от изменения цены которых зависит величина дополнительного дохода, выплачиваемого в дату погашения Индексной облигации, в дату



выплаты купона по Индексной облигации или в иную дату, определенную условиями выпуска такой облигации.

Кредитные риски Эмитента Индексной облигации, а также кредитный риск эмитентов ценных бумаг, составляющих Базовый актив индексной облигации.

Риски ликвидности Индексной облигации в связи с остановкой или нарушением торгов на вторичном рынке Индексной облигации, либо торгов ценными бумагами, составляющими Базовый актив Индексной облигации, либо отсутствием встречных заявок на покупку/продажу Индексных облигаций.

Риски изменения условий существования Базовых активов: условия существования Базовых активов Индексных облигаций могут изменяться в связи с наступлением существенных событий, таких как остановка или нарушение торгов на Базовый актив Индексной облигации, замена Базового актива Индексной облигации и/или досрочное погашение Индексной облигации по причинам, связанным с реорганизацией (включая слияние, поглощение, дробление акций, ликвидацию и т.п.) одного или нескольких эмитентов, чьи ценные бумаги входят в Базовый актив Индексной облигации.

Риски возникновения затруднений в оценке справедливой стоимости Базового актива Индексной облигации и Индексной облигации по причинам, связанным с остановкой или нарушением торгов на Базовый актив Индексной облигации, либо с реорганизацией (включая слияние, поглощение, дробление акций, ликвидацию и т.п.) одного или нескольких эмитентов, чьи ценные бумаги входят в состав Базового актива Индексной облигации.

Риск разнонаправленной динамики компонентов индекса. Когда базисным активом является индекс, отрицательные показатели одного из компонентов такого базисного актива могут нивелировать любые положительные показатели других компонентов. Значительные изменения показателей одного или нескольких компонентов могут быть снижены за счет обратной динамики поведения показателей иных компонентов, входящих в индекс. Данный эффект может усилиться, если компоненты имеют разный «удельный вес» (т.е. процентную долю при расчете) в индексе. При этом чем больше «удельный вес» компонента, тем значительней окажется его воздействие на индекс.

Валютные риски при расчете налога: согласно законодательству Российской Федерации доходы и расходы в иностранных валютах оцениваются в рублях Российской Федерации. Проводя операции с ценными бумагами, номинированными в иностранных валютах, резидент Российской Федерации принимает на себя риск изменения эффективной ставки налогообложения в зависимости от колебания курсов валют.

Риски, связанные с неопределенностью налоговых последствий инвестиций в Индексные облигации.

Риски при продаже Индексных облигаций до наступления срока погашения, поскольку обязательство возврата (полного или частичного) Эмитентом первоначально инвестированного капитала действует только на дату погашения Индексной облигации.

Риски инвестирования в Индексные облигации, вызванные изменением рыночной цены Базового актива Индексной облигации и, как следствие, неполучение дополнительного дохода.

Риски, связанные с изменением сроков поставки Индексных облигаций по независящим от Эмитента и/или его дочерних и аффилированных структур причинам, в том числе связанные с неисполнением и/или несвоевременным исполнением третьим лицом (контрагентом) обязательств по сделке, заключенной по поручению инвестора.

И иные риски.