



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 002P-11-USDRUB_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 0,0475;

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

D – количество всех Рабочих дней в течение Периода наблюдения;

Период наблюдения – с 19.11.2019 (включительно) по 14.05.2020 (включительно);

Базовый актив – курс доллара США к рублю РФ, устанавливаемый Банком России для расчетов, начиная со следующего дня, и публикуемый на странице в сети Интернет http://cbr.ru/currency_base/daily/ или иной странице в сети Интернет, используемой Банком России для раскрытия данной информации, округлённый до четырех знаков после запятой (округление производится по правилам математического округления, а именно: в случае если пятый знак после запятой больше или равен 5, четвертый знак после запятой увеличивается на единицу, в случае если пятый знак после запятой меньше 5, четвертый знак после запятой не изменяется);

Начальное значение Базового актива – значение Базового актива, установленное в дату начала размещения Биржевых облигаций для расчетов, начиная со следующего дня.

Диапазон целевых значений – диапазон значений Базового актива с Начального значения Базового актива, уменьшенного на 0,3%, (включительно) до Начального значения Базового актива, увеличенного на 3,0% (включительно);

Рабочие дни – дни, не являющиеся выходными и/или праздничными в соответствии с законодательством Российской Федерации.

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 – в случае, если одновременно не выполняются следующие условия:

- a. Значение Базового актива может быть определено в каждую дату Периода наблюдения;
- b. Существует не менее одной даты 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).