

Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 002P-17- 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 **0,1**;

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 **07.10.2020** (включительно) по **04.10.2021** (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).

В случае, если в какую-либо дату Периода наблюдения значение Базового актива не может быть определено, то данная дата исключается из расчета **d**.

Диапазон целевых значений – диапазон значений Базового актива, начиная со значения, определяемого по формуле и равного **0,99*P_{нач}** (включительно) и до значения, определяемого по формуле и равного **1,09*P_{нач}** (включительно), где **P_{нач}** – стоимость золота в долларах США за тройскую унцию опубликованная 06.10.2020 17:30 (Мск) в информационной системе Блумберг (тикер «XAUUSD Curncy»). 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:

$ДД (\%) = 0,00\%$.

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):

$$ДД (\text{руб}) = ДД (\%) * N$$

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).

Дополнительный доход в процентах и в рублях Российской Федерации рассчитывается не позднее одного рабочего дня до даты погашения выпуска в соответствии с положениями, определенными выше.