

**ГАЗПРОМБАНК**

**Параметры выпуска биржевых облигаций
Банка ГПБ (АО) с дополнительным доходом
серии 002P-18-GAZP_CALL_SPREAD**

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
Регистрационный номер выпуска облигаций	4B02-18-00354-B-002P
Серия облигаций	002P-18-GAZP_CALL_SPREAD
Кредитный рейтинг бумаги	Отсутствует
Номинальная стоимость	1 000 рублей
Объем выпуска	500 000 000 (Пятьсот миллионов) рублей
Срок обращения	365 дней
Оферта	отсутствует
Купонный период	365 дней
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 30.11.2020 по 08.12.2020 Дата активации (удовлетворения) предварительных заявок: 09.12.2020 (равна дате начала размещения)
Предварительная дата начала размещения и метод проведения расчетов	09.12.2020 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-18-GAZP_CALL_SPREAD

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

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

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 рублях;

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

БА_{бар} – Барьерное значение Базового актива, равное **БА_{нач}*1,30**, в рублях;

K – коэффициент участия, равный **0,40**;

Базовый актив – цена закрытия, в рублях Российской Федерации, 1 (одной) обыкновенной акции ПАО «Газпром» (ISIN: RU0007661625) в секции фондового рынка ПАО Московская Биржа (далее – Биржа), публикуемая на странице в сети Интернет <https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=GAZP> (поле «Цена закрытия») (или иная страница в сети Интернет, используемая Биржей для раскрытия данной информации), 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).

Дата определения значения Базового актива:

А) 2-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.1 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.1 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 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 Базового актива в указанные даты до тех пор, пока значение Базового актива не будет определено).

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 значение Базового актива не может быть определено в указанные даты в соответствии с положениями настоящего пп.1, то считается, что для расчета дополнительного



дохода выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, как оно определено в пп.2 ниже.

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** – значение Базового актива в Дату определения значения Базового актива ($\text{БА}_{\text{фин}}$) не может быть определено в соответствии с положениями пп.1 выше.

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

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

где:

$\text{ДД (\%)}$ – 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



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.