

Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 002P-19- XAGUSD_KO_STRADDLE

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

$$\text{ДД (\%)} = K * \text{ABS}(\text{БА}_{\text{фин}} / \text{БА}_{\text{нач}} - 1) * b1 * b2 * 100\%$$

где:

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

ABS – функция приведения числа к абсолютной величине (модулю числа);

БА_{нач} – значение Базового актива на дату размещения Биржевых облигаций, в долл. США;

БА_{фин} – значение Базового актива на Дату определения значения Базового актива, в долл. США;

b1 = 0, если $(\text{БА}_{\text{фин}} / \text{БА}_{\text{нач}} - 1) \leq -0,15$, иначе = 1;

b2 = 0, если $(\text{БА}_{\text{фин}} / \text{БА}_{\text{нач}} - 1) \geq 0,30$, иначе = 1;

K – коэффициент участия, равный **0,50**;

Базовый актив – фиксинг по серебру в долларах США за унцию, определяемый расчетным администратором Межконтинентальной биржи (ICE Benchmark Administration) и публикуемый на сайте Лондонской ассоциации рынка драгоценных металлов (London Bullion Market Association) в соответствующем разделе <http://www.lbma.org.uk/precious-metal-prices>, 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).

Рабочий 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>.

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 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 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 пп.1 выше, 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:

$ДД (\%) = 0,00\%$.

2. **Условие невыплаты дополнительного дохода** – значение Базового актива в Дату определения значения Базового актива ($БА_{фин}$) 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):

$$ДД (\text{руб}) = ДД (\%) * N$$

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