



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по облигациям Банка ГПБ (АО) серии ГПБ-КИ-03

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

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

где:

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

max – функция максимального значения указанных переменных;

БА_{нач} – значение Базового актива на предыдущий рабочий день (29.09.2021) от даты начала размещения Облигаций (30.09.2021), в долларах США;

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

K – коэффициент участия, равный 0,8;

USDRUB_{нач} – спот-курс рубля РФ к доллару США (Spot BFIX), выраженный как количество рублей за один доллар США, опубликованный в Дату начала размещения Облигаций в Bloomberg на странице BFIX цена «Mid» по состоянию на 18:30 по Москве;

USDRUB_{фин} – спот-курс рубля РФ к доллару США (Spot BFIX), выраженный как количество рублей за один доллар США, опубликованный на 2-ой рабочий день, предшествующий Дате выплаты дополнительного дохода (далее – Дата определения **USDRUB_{фин}**), в Bloomberg на странице BFIX цена «Mid» по состоянию на 18:30 по Москве. Если на Дату определения **USDRUB_{фин}** по любым причинам невозможно получить информацию о значении спот-курс рубля РФ к доллару США (Spot BFIX) в Bloomberg на странице BFIX цена «Mid» по состоянию на 18:30 по Москве, то используется курс доллара США к рублю РФ, установленный ЦБ РФ на следующий после Даты определения **USDRUB_{фин}** рабочий день.

Базовый актив – 1 (один) инвестиционный пай «SPDR S&P 500 ETF TRUST SPY» (ISIN: US78462F1030) <https://www.ssga.com/us/en/intermediary/etfs/funds/spdr-sp-500-etf-trust-spy> на Нью-Йоркской фондовой бирже (New York Stock Exchange). Значением базового актива на дату является цена закрытия на эту дату в долларах США 1 (одного) инвестиционного пая, публикуемая на странице в сети Интернет <https://www.nyse.com/quote/ARCX:SPY> (поле «LAST»), либо на иной странице в сети Интернет, на которой в соответствующий момент времени будет публиковаться такая информация, 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 выплаты дополнительного дохода – 29.09.2024.

Если дата выплаты дополнительного дохода по Облигациям приходится на нерабочий праздничный или выходной день - независимо от того, будет ли это государственный выходной день или выходной день для расчетных операций, – то перечисление подлежащей суммы производится в первый рабочий день, следующий за нерабочим праздничным или выходным.

Владелец Облигаций не имеет права требовать начисления процентов или какой-либо иной компенсации за такую задержку в платеже.

Дата определения значения Базового актива:



А) 3-ой рабочий день, предшествующий Дате выплаты дополнительного дохода (в случае, если в указанную дату значение Базового актива может быть определено в соответствии с положениями п.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 п.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 выплаты дополнительного дохода (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, 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:

$$\text{ДД} (\%) = 0,00\%.$$

2. Условие невыплаты дополнительного дохода:

(А) значение Базового актива в Дату определения значения Базового актива (БАфин) не может быть определено в соответствии с положениями пп.1 выше, либо

(Б) делистинг ценных бумаг инвестиционного фонда **на Нью-Йоркской фондовой бирже (New York Stock Exchange) или на правопреемнике данной биржи (при наличии).**

3. Порядок расчета суммы дополнительного дохода, подлежащего выплате на одну 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 Облигации, равная 1 000 рублей.

Дополнительный доход в рублях Российской Федерации, подлежащий выплате на одну 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 выплаты дополнительного дохода в соответствии с положениями, определенными выше.