



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по облигациям Банка ГПБ (АО) серии ГПБ-КИ-04

1. В случае если не выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода (как оно определено в п. 5.1):

$$\text{ДД (в \%)} = \left\{ \sum_{i=1}^4 \max \{ K * [(\min(P_i; P_{i, \max}) - P_{i, \text{нач}}) / P_{i, \text{нач}}]; 0 \} / 4 \right\} * 100\%$$

где:

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

max – функция максимального значения указанных переменных;

min – функция минимального значения указанных переменных;

P_{i,нач} - значение i-го Базового актива из Корзины Базовых активов на дату размещения облигаций (11.10.2021), в рублях;

P_i - значение i-го Базового актива из Корзины Базовых активов на Дату определения значения Базового актива, в рублях;

P_{i,max} = P_{i,нач} + 30% - верхняя граница значения i-го Базового актива, входящего в Корзину Базовых активов, в рублях;

K – коэффициент участия, равный 0,55;

2. Корзина Базовых активов:

i-ый Базовый актив	Значение i-го Базового актива
1-ый Базовый актив	Цена закрытия, в рублях Российской Федерации, 1 (одной) депозитарной расписки иностранного эмитента на акции «Икс 5 Ритейл Груп Н.В.» (ISIN: US98387E2054) в секции фондового рынка Московской биржи, публикуемая на странице в сети Интернет https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=FIVE&utm_source=www.moex.com&utm_term=five * (поле «Цена закрытия»)
2-ой Базовый актив	Цена закрытия, в рублях Российской Федерации, 1 (одной) депозитарной расписки иностранного эмитента на акции «Mail.ru Group Limited» (ISIN: US5603172082) в секции фондового рынка Московской биржи, публикуемая на странице в сети Интернет https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=MAIL&utm_source=www.moex.com&utm_term=mail * (поле «Цена закрытия»)
3-ий Базовый актив	Цена закрытия, в рублях Российской Федерации, 1 (одной) депозитарной расписки иностранного эмитента на акции «ETALON GROUP PLC» (ISIN: US29760G1031) в секции фондового рынка Московской биржи, публикуемая на странице в сети Интернет https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=ETLN&utm_source=www.moex.com&utm_term=etln * (поле «Цена закрытия»)
4-ый Базовый актив	Цена закрытия, в рублях Российской Федерации, 1 (одной) обыкновенной акции ПАО «Нефтяная компания «Роснефть» (ISIN: RU000A0J2Q06) в секции фондового рынка Московской биржи, публикуемая на странице в сети Интернет https://www.moex.com/ru/issue.aspx?board=TQBR&code=ROSN&utm_source=www.moex.com&utm_term=rosn * (поле «Цена закрытия»)

* - или иная страница в сети Интернет, используемая Московской биржей для раскрытия данной информации.

Значение Базового актива округляется 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).

3. **Дата выплаты дополнительного дохода – 11.10.2022.**



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.

4. Дата определения значения Базового актива:

А) 2-ой рабочий день, предшествующий Дате выплаты дополнительного дохода (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 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).

5. В случае если выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, как оно определено в пп. 5.1 ниже:

$$\text{ДД (\%)} = 0,00\%.$$

5.1. Условие невыплаты дополнительного дохода – значение всех Базовых активов (P_i) в Дату определения значений Базовых активов (P_i) признается равным нулю в соответствии с положениями п. 5.2 или значение всех Базовых активов (P_i) в Дату определения значений Базовых активов (P_i) составляет менее их значений в Дату начала размещения Облигаций ($P_{i, \text{нач}}$).

5.2. P_i признается равным нулю в любом из следующих случаев:

5.2.1. значение P_i не может быть определено в Даты определения значения Базового актива в соответствии с положениями п.4 выше;

5.2.2. исключение Базового актива из списка ценных бумаг, допущенных к организованным торгам на Московской бирже или организаторе торгов – правопреемнике Московской биржи (при наличии).

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



7. 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).

8. 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.