



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по облигациям Банка ГПБ (АО) серии ГПБ-КИ-12

1. В случае если не выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, определенное в пункте в пп. 2. ниже:

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

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 (27.12.2022) Облигаций, в долларах США;

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

БА_в – верхняя граница Базового актива, равная **БА_{нач} * 1,40**, в долларах США;

USDRUB_{нач} – спот-курс рубля РФ к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар США, установленный Центральным Банком Российской Федерации в дату размещения (27.12.2022), действующий на следующий после даты размещения облигаций день;

USDRUB_{фин} – спот-курс рубля Российской Федерации к доллару США, выраженный как количество рублей за один доллар США, установленный Центральным банком Российской Федерации в Дату определения значения Базового актива, действующий на следующий после Даты определения значения Базового актива день;

К – коэффициент участия, равный **0,80**.

Базовый актив – Утренний фиксинг цены на золото (ежедневное определение цены на золото публикуемое в 10:30 по Гринвичу) 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 Gold Prices USD AM <https://www.lbma.org.uk/prices-and-data/precious-metal-prices#/table>.

Дата выплаты дополнительного дохода – 26.12.2024.

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. 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 пункта 1 выше).

Б. Если на Дату определения значения Базового актива, указанную в пункте А, значение Базового актива не опубликовано на странице в сети Интернет, на которой публикуется такое значение в соответствии с положениями пункта 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-й, 4-й, 5-й, ..., (n-1)-й, n-й 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 пункта 1 настоящего Порядка, то считается, что для расчета дополнительного дохода выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, как оно определено в пункте 2 ниже.

В случае если выполняется Условие невыплаты дополнительного дохода, определенное в пункте 2 ниже:

$$\text{ДД (\%)} = 0,00\%.$$

2. **Условие невыплаты дополнительного дохода** – значение Базового актива в Дату определения значения Базового актива (БАфин) не может быть определено в соответствии с положениями пункта 1 выше.

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.