



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по облигациям Банка ГПБ (АО) серии ГПБ-КИ-05

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

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

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 определения начального значения Базового актива, в пунктах;

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

БА_в – Верхняя граница Базового актива, равное **БА_{нач}*1,50**, в пунктах;

К – коэффициент участия, равный **0,64**;

Базовый актив – значение «Индекса МосБиржи» (ISIN: RU000A0JP7K5), рассчитываемое ПАО Московская Биржа в соответствии с Методикой расчетов Индексов Московской Биржи, публикуемое на странице в сети Интернет <https://www.moex.com/ru/index/ИМОЕХ/archive> (поле «Закрытие») (или иная страница в сети Интернет, используемая ПАО Московская Биржа для раскрытия данной информации), округлённое 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 – 02.02.2025.

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 начального значения Базового актива:

А) Дата размещения Облигаций (03.02.2023).

Б) В случае если на дату размещения Облигаций, 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 начального значения Базового актива является 1-ый, 2-ой, ..., (m-1)-ый, m-ый рабочий день (заканчивая Датой определения финального значения Базового актива как она определена ниже), последующий за датой размещения Облигаций (т.е. последовательно проводится определение значения Базового актива в указанные даты до тех пор, пока значение Базового актива не будет



определено).

Дата определения финального 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 финального 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 финального значения Базового актива является последовательно 3-ый, 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 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:

$$\text{ДД (\%)} = 0,00\%.$$

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