



Порядок определения и условия выплаты дополнительного дохода по биржевым облигациям Банка ГПБ (АО) серии 004P-06

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

1.1. Дополнительный доход (в процентах) для Даты выплаты № 1 и Даты выплаты № 2 рассчитывается по следующей формуле: $ДД(\%) = 0,02\%$

1.2. Дополнительный доход (в процентах) для Даты выплаты №3 рассчитывается по следующей формуле: $ДД(\%) = K * \max\{BA_{фин} / BA_{нач} - 1\}; 0\} * 100\%$

где:

$ДД\%$ – размер дополнительного дохода, в процентах;

K – коэффициент участия, равный 80%;

$BA_{нач}$ – значение Базового актива на Дату определения начального значения Базового актива, в рублях РФ;

$BA_{фин}$ – значение Базового актива на Дату определения финального значения Базового актива, в рублях РФ;

Базовый актив – цена закрытия, в рублях Российской Федерации, 1 (одной) обыкновенной акции ПАО «НК «Роснефть» (ISIN: RU000A0J2Q06) в секции фондового рынка ПАО Московская Биржа (далее – Биржа), публикуемая на странице в сети Интернет https://www.moex.com/ru/marketdata/#/mode=instrument&secid=ROSN&boardgroupid=57&mode_type=history&date_from (поле «Закрытия») (или иная страница в сети Интернет, используемая Биржей для раскрытия данной информации), 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 определения начального значения Базового актива:

А) Дата начала размещения Биржевых облигаций (31.05.2024).

Б) В случае если на дату начала размещения Биржевых облигаций, указанную в п. (А), значение Базового актива не опубликовано на странице в сети Интернет, на которой публикуется такое значение в соответствии с положениями настоящего пункта 1, 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), последующий за датой размещения Биржевых 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: 27.05.2027

Если на Дату определения финального значения Базового актива, как она определена выше значение Базового актива не опубликовано на странице в сети Интернет, на которой публикуется такое значение в соответствии с положениями настоящего пункта 1, 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 1-ый, 2-ый, ..., (n-1)-ый, n-ый рабочий день (заканчивая датой начала размещения), предшествующий Дате определения финального значения Базового актива (т.е. последовательно проводится определение значения Базового актива в указанные даты до тех пор, пока значение Базового актива не будет определено).

Даты выплаты дополнительного дохода:

Порядковый номер выплаты	Дата выплаты
Дата выплаты №1	31.05.2025
Дата выплаты №2	31.05.2026
Дата выплаты №3	31.05.2027

Если какая-либо из указанных Дат выплаты дополнительного дохода 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 днем.



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

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 пункта 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: $ДД (\%) = 0,00\%$.

2. **Условие невыплаты дополнительного дохода** – значение Базового актива в Дату определения финального значения Базового актива не может быть определено в соответствии с положениями пунктом 1.

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).

4. **Дата погашения Биржевых облигаций:** 31.05.2027.