



119121, Российская Федерация, Москва, Большой Саввинский переулок, дом 10, стр. 2А

Тел./факс: +7 (499) 286 20 31

ПРИКАЗ № 06/02/2020/SFO VTB IP

г. Москва

«17» июля 2020 г.

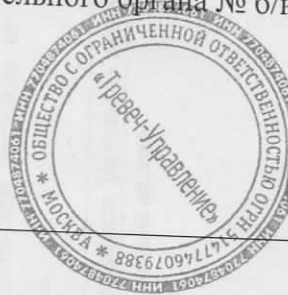
об определении ключевых условий выпуска по структурным облигациям ООО СФО ВТБ Инвестиционные Продукты серии 03

В соответствии с решением о выпуске структурных процентных неконвертируемых бездокументарных облигаций ООО СФО ВТБ Инвестиционные Продукты с централизованным учетом прав серии 03, регистрационный номер 6-03-00545-R от 09.07.2020 (далее именуются «**Облигации**»)

ПРИКАЗЫВАЮ

определить числовые значения, параметры, условия и(или) порядок их определения, в зависимости от наступления или ненаступления которых осуществляются либо не осуществляются выплаты по Облигациям и (или) определяется размер таких выплат и (или) порядок его определения в соответствии с Приложениями № 1-5 к настоящему Приказу.

Директор Общества с ограниченной ответственностью «Тревеч - Управление» – управляющей организации Общества с ограниченной ответственностью Специализированное финансовое общество ВТБ Инвестиционные Продукты, действующей на основании решения единственного учредителя Общества с ограниченной ответственностью Специализированное финансовое общество ВТБ Инвестиционные Продукты (Решение № 1 от 27.12.2018 г.) и договора о передаче полномочий единоличного исполнительного органа № б/н от 22 марта 2019 года



Л.В. Лесная

**Решение о ключевых условиях выпуска структурных процентных неконвертируемых бездокументарных облигаций ООО СФО ВТБ
Инвестиционные Продукты с централизованным учетом прав серии 03, регистрационный номер 6-03-00545-R от 09.07.2020
(«Облигации»)**

Если в настоящем решении не указано иное, термины, употребляемые в нем с заглавной буквы, имеют значение, указанное в решении о выпуске Облигаций.

1.	Признаки Базового актива		
1.1.	Базовый актив	Контрольное лицо	полное фирменное наименование: Русал Кэпитал ДиЭйСи (Rusal Capital D.A.C.) сокращенное фирменное наименование (при наличии): Русал Кэпитал (Rusal Capital) для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием типа идентифицирующего номера, если применимо: 549300VAUKY08SYXL004 (LEI) ИНН (при наличии): не применимо место нахождения и адрес: 2-ой этаж, Палмерстон Хаус, Фениан Стрит, Дублин, АйИ-Ди Ди02 Дабл-юДи37 (2nd Floor, Palmerston House, Fenian Street, Dublin, IE-D D02 WD37, Ireland)
		ISIN Базового актива	XS1759468967
		Объем актива	Будет определен Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций
		Организатор торгов	полное фирменное наименование: Евронекст Дублин (Euronext Dublin) (ранее – Айриш Сток Иксчэндж пиэлси (Irish Stock Exchange plc)) сокращенное фирменное наименование (при наличии): не применимо для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо для иностранных юридических лиц – международный код

			<p>идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием типа идентифицирующего номера, если применимо: 539157 (регистрационный номер юридического лица)</p> <p>ИНН (при наличии): не применимо</p> <p>место нахождения и адрес: Иксчэндж Билдингс, Фостер Плейс, Дублин 2, Ирландия (Exchange Buildings, Foster Place, Dublin 2, Ireland)</p> <p>Страница организатора торгов: https://www.ise.ie/, https://www.euronext.com/en/markets/dublin</p>
		<p>Условия, при которых обязательства Контрольного лица будут считаться нарушенными (события дефолта) в соответствии с условиями эмиссии облигации (Кредитные события)</p>	<p>Условиями, при которых обязательства Контрольного лица будут считаться нарушенными, является любой из Случаев неисполнения обязательств, как такие случаи определены в программе Нот (далее «Условия эмиссии Базового актива»).</p> <p>Условия эмиссии Базового актива являются документом, составленным на иностранном языке. В информационных целях ниже приведен перевод текста с описанием Случаев неисполнения обязательств и использованных терминов с иностранного языка на русский язык. Во избежание сомнений, неточностей и двусмысленностей, неизбежно возникающих при переводе текста с одного языка на другой, до приобретения Облигаций, лицу, предполагающему осуществить их приобретение, необходимо самостоятельно ознакомиться с соответствующими положениями Условий эмиссии Базового актива на языке оригинала.</p> <p>При расхождении описания Случаев неисполнения обязательств и терминов, содержащегося в Сообщении о ключевых условиях, с описанием, содержащимся в Условьях эмиссии Базового актива, содержание Условий эмиссии Базового актива будет иметь преимущественное значение перед содержанием Сообщения о ключевых условиях.</p> <p>Случаи неисполнения обязательств</p> <p>Если происходит какой-либо случай неисполнения обязательств (далее – «Случай неисполнения обязательств»), то Доверительный управляющий по собственному усмотрению может, а если этого требуют в письменной форме Владельцы не менее одной четверти совокупной номинальной</p>

			<p>стоимости непогашенных Нот или если это предписано Решением (Extraordinary Resolution), должен предоставить (при условии, что Доверительному управляющему обеспечено возмещение потерь и (или) предоставлено обеспечение, и (или) произведена авансовая выплата) письменное уведомление Эмитенту, объявляющее Ноты подлежащими немедленному погашению, после которого они будут подлежать немедленному погашению по номинальной стоимости вместе с начисленными процентами без необходимости дальнейших действий или формальностей:</p> <p>(a) <i>Неисполнение обязательств по уплате денежных средств (Non-payment)</i>: Эмитент не выплачивает сумму основного долга по Нотам не позднее седьмого Рабочего дня после истечения срока для выплаты такой суммы или не выплачивает сумму процентов по Нотам не позднее десятого Рабочего дня после истечения срока для выплаты процентов; или</p> <p>(b) <i>Иное нарушение обязательств (Breach of other obligations)</i>: Эмитент или Поручитель, в зависимости от обстоятельств, не выполняет или не соблюдает любые другие обязательства по Нотам, Поручительствам или Договору о доверительном управлении или в отношении них, в зависимости от обстоятельств, и такое невыполнение (i) по мнению Доверительного управляющего, не может быть устранено или (ii) является невыполнением, которое, по мнению Доверительного управляющего, может быть устранено, но не устраняется в течение 45 календарных дней с момента предоставления Доверительным управляющим письменного уведомления Эмитенту и Поручителю об этом, в зависимости от обстоятельств; или</p> <p>(c) <i>Кросс-Дефолт (Cross-default) Эмитента, Поручителя или Основной дочерней компании</i>:</p> <p>(i) любая Задолженность Эмитента, Поручителя или любых других Основных дочерних компаний не выплачивается в положенный срок или (в зависимости от обстоятельств) в течение любого изначально</p>
--	--	--	---

			<p>установленного грэйс периода; или</p> <p>(ii) любая такая Задолженность (за исключением любой Задолженности, возникающей на основании любых гарантий исполнения или аналогичного обеспечения исполнения обязательств в отношении Проектного Финансирования без права обратного требования, и в той степени, в которой это разрешено в соответствии с определением этого термина) подлежит выплате до истечения первоначально установленного срока в результате случая неисполнения обязательств, как бы такой случай ни был определен;</p> <p>и при условии, что сумма Задолженности, указанная в вышеуказанном подпункте (i) и (или) подпункте (ii), по отдельности или в совокупности превышает 50 000 000 долларов США (или эквивалент этой суммы в любой другой валюте или валютах); или</p> <p>(d) <i>Неисполнение судебного решения (Unsatisfied judgment)</i>: за исключением любого решения в связи со спором с компанией «Би-Эф-Ай-Джи Груп Дивино Корпорейшн» (BFIG Group Divino Corporation), существующим по состоянию на Дату эмиссии, информация о котором раскрыта в Итоговом листинговом проспекте, одно или несколько окончательных не подлежащих обжалованию решений или судебных приказов о выплате суммы свыше 50 000 000 долларов США (или ее эквивалента в любой другой валюте или валютах), по отдельности или совместно, вынесено против Эмитента, Поручителя или любых других Основных дочерних компаний и остается (остаются) неисполненным(и) в течение 60 календарных дней после даты (дат) их вынесения или (если позднее) даты, указанной в них для платежа; или</p> <p>(e) <i>Обращение взыскания на обеспечение (Security enforced)</i>: сторона, которой предоставлено обеспечение, приобретает все или существенную часть предприятия, активов и доходов Эмитента, Поручителя или любой другой Основной дочерней компании, или в их отношении назначается</p>
--	--	--	--

			<p>судебный распорядитель, управляющий или иное подобное должностное лицо, но, во избежание сомнений, за исключением случая, когда стоимость указанного по отдельности или в совокупности не превышает 50 000 000 долл. США (или эквивалент этой суммы в любой другой валюте или валютах); или</p> <p>(f) <i>Банкротство и ликвидация и прочие подобные процедуры (Insolvency and winding up, etc):</i> наступление любого из следующих событий:</p> <p>(i) Эмитент, Поручитель или любая другая Основная дочерняя компания прекращает существование в качестве юридического лица или ходатайствует о начале, или соглашается с началом процедуры ликвидации или назначением ликвидатора, или ликвидационной комиссии, или аналогичного должностного лица такого юридического лица, в зависимости от обстоятельств, или осуществляют любое другое корпоративное действие в отношении такого лица с целью его ликвидации;</p> <p>(ii) представление или подача заявления в отношении Эмитента, Поручителя или любой другой Основной дочерней компании (в любом суде, уполномоченном рассматривать такое дело, арбитражном суде или в любом компетентном органе с заявлением или с целью осуществления процедуры банкротства, несостоятельности, внешнего наблюдения, управления, реорганизации, ликвидации (или любой аналогичной процедуры), включая в случае любого юридического лица, созданного в соответствии с законодательством Российской Федерации введение наблюдения, финансового оздоровления, внешнего управления или конкурсного производства в соответствии с определением этих терминов в Федеральном законе Российской Федерации № 127-ФЗ «О несостоятельности (банкротстве)» от 26 октября 2002 г. (далее - «Закон о банкротстве»)) любым таким лицом, когда такое заявление было принято таким судом или компетентным органом для рассмотрения по</p>
--	--	--	---

			<p>существо (но исключая любую такую процедуру, которая является необоснованной и отклоняется в течение 45 календарных дней с даты принятия такого заявления компетентным судом);</p> <p>(iii) установление в отношении Эмитента, Поручителя или любой другой Основной дочерней компании или согласие любого из них на мировое соглашение, компромиссное соглашение, уступку, соглашение, отсрочку платежей, подконтрольное управление, отчуждение имущества с целью обмана кредиторов, реорганизацию или подобную процедуру или меры, влияющие на права кредиторов в общем, которые в случае если юридическое лицо создано в соответствии с законодательством Российской Федерации, в частности, включают проведение санации (<i>санация</i> согласно определению в Законе о банкротстве), заключение мировой сделки (включая <i>мировое соглашение</i> согласно определению в Законе о банкротстве) с кредиторами в общем;</p> <p>(iv) любая внесудебная ликвидация или аналогичное действие в отношении Эмитента, Поручителя или любой другой Основной дочерней компании, осуществленные любым государственным, регулирующим или надзорным органом; или</p> <p>(v) Эмитент, Поручитель или любая другая Основная дочерняя компания не может выплатить или признает в письменном виде свою неспособность выплатить свои долги в общем по мере наступления срока их погашения, в общем приостанавливает выплаты по своим долгам; и (или) объявляется мораторий в отношении всей или существенной части Задолженности любого Эмитента, Поручителя или любой другой Основной дочерней компании; или</p> <p>(g) <i>Аналогичный случай (Analogous event)</i>: любой случай, который в соответствии с законодательством любой соответствующей страны или территории имеет действие, аналогичное действию любого из событий, упомянутых в вышеизложенном пункте (f);или</p>
--	--	--	--

(h) *Непринятие мер и иные подобные действия (Failure to take action, etc.):* любое действие, условие или вопрос, которые необходимо предпринять, осуществить или решить с целью (i) предоставления Эмитенту или Поручителю законной возможности принятия, выполнения и соблюдения обязательств на основании или в отношении Нот, Поручительств или Договора о доверительном управлении, в зависимости от обстоятельств, (ii) обеспечения законности, действительности, обязательной силы и возможности принудительного исполнения указанных обязательств, и (iii) обеспечения допустимости Нот, Поручительств или Договора о доверительном управлении в качестве доказательства в арбитражном суде в г. Лондоне, не предпринято, осуществлено или не решено, и такие обстоятельства продолжают существовать в течение более 60 календарных дней;

(i) *Несоответствие законодательству (Unlawfulness):* в любой момент времени является или становится противозаконным соблюдение Эмитентом или Поручителем обязательств на основании Нот, Поручительств или Договора о доверительном управлении, или такие обязательства не являются законными, действительными, имеющими обязательную силу и обладающими возможностью быть принудительно исполненными, или Эмитент или Поручитель оспаривает их действительность или аннулирует их (или предпринимает попытки аннулировать), и такое событие длится более 60 календарных дней;

(j) *Недействительность Поручительства (Guarantee not in force):* Поручительство не действует в полной мере в соответствии с его условиями (или объявляется таковым Поручителем); или

(k) *Вмешательство государства (Government intervention):* любой арест, принудительное отчуждение, экспроприация, национализация без соответствующей компенсации или повторная национализация после Даты эмиссии всех или существенной части активов Эмитента, Поручителя или любой другой Основной дочерней компании государственным органом или на основании его полномочий.

Использованные термины:

«Доверительный управляющий» означает БиЭнУай Меллон Корпорейт Трасти Сервисез Лимитед (BNY Mellon Corporate Trustee Services Limited) (LEI 2138009FOQYJ464QNK39).

«Решение (Extraordinary Resolution)» имеет значение, указанное в Договоре о доверительном управлении.

«Рабочий день» означает день, который (а) является торговым днем на Лондонском межбанковском рынке, и (b) в отношении срока для уведомления или передачи документов, или иного подтверждения членом Группы, день, который является рабочим днем для коммерческих банков в Нью Йорке, Никосии, Дублине, Москве, Джерси, Лондоне, Гонконге, Вене и Люксембурге и в городе, где расположено соответствующее отделение Основного Платежного Агента.

«Поручительство» означает безусловное и безотзывное поручительство по Нотам, предоставленное Поручителями.

«Эмитент» означает Русал Кэпитал ДиЭйСи (Rusal Capital D.A.C._ (данные государственной регистрации: №590956, IE001).

«Ноты» означает еврооблигации Русал Кэпитал ДиЭйСи (Rusal Capital D.A.C.) общим номиналом 500 000 000 долларов США с датой погашения 1 февраля 2023 года (ISIN: XS1759468967)

«Поручитель» означает Юнайтед Кампани Русал Пиэлси (United Company Rusal Plc) (данные государственной регистрации: №94939 от 20.10.2006, RA000414) и АрТиАй Лимитед (RTI Limited) (данные государственной регистрации: №94961) (учрежденные в Джерси), АО "РУСАЛ Красноярский алюминиевый завод" (ОГРН: 1022402468010), АО "РУСАЛ Саяногорский алюминиевый завод" (ОГРН: 1021900670758),

ПАО "РУСАЛ Братский алюминиевый завод" (ОГРН: 1023800836377) (учрежденные в Российской Федерации).

«Договор о доверительном управлении» означает договор

			<p>доверительного управления, заключенный между Доверительным управляющим, Эмитентом и Поручителями.</p> <p>«Основная компания», «Компания» означает Юнайтед Кампани Русал Пиэлси (United Company Rusal Plc) (учрежденную в Джерси).</p> <p>«Основная дочерняя компания» означает Дочернюю компанию по отношению к Основной компании (за исключением компании Активиум ХолдингБи.Ви. (Aktivium Holding B.V.) или другого члена Группы, который владеет акциями ПАО ГМК Норильский Никель (ОГРН: 1028400000298)):</p> <p>(a) выручка (revenue) которой (исключая внутригрупповые статьи) составляет не менее чем 10 % консолидированной выручки (revenue) Группы; или</p> <p>(b) совокупные активы (total assets) которой (исключая внутригрупповые статьи) составляет не менее чем 10% консолидированных совокупных активов (total assets) Группы; или</p> <p>(c) компанию, которая получила все или существенную часть обязательств и имущества Дочерней компании, которая до такой передачи являлась Основной дочерней компанией.</p> <p>Для случаев (a) и (b) выше расчет производится на основании последней консолидированной годовой или полугодовой промежуточной отчетности Юнайтед Кампани Русал Пиэлси (United Company Rusal Plc).</p> <p>«Дочерняя компания» по отношению к какому-либо лицу означает корпорацию, товарищество, совместное предприятие, объединение или иное коммерческое юридическое лицо, существующее или созданное или приобретенное в будущем, (a) для корпораций или иного коммерческого юридического лица, в котором Основное общество владеет или контролирует более чем 50 % выпущенного акционерного капитала или владеет долей, предоставляющей право избрать (назначить, сформировать) большинство в органах управления (директоров,</p>
--	--	--	---

			<p>управляющих или доверительных управляющих) в такой корпорации или ином коммерческом юридическом лице; b) для товарищества, совместного предприятия, объединения или иного коммерческого юридического лица, в которых Основное общество или его Дочерняя компания имеют полномочия указывать (определять содержание политик), а также указывать или обеспечить выполнение таких указаний менеджментом таких лиц; или (c) если в соответствии с МСФО такое лицо должно быть консолидировано с Основной компанией для целей составления финансовой отчетности.</p> <p>«МСФО» означает Международные стандарты финансовой отчетности или иные общепринятые стандарты финансовой отчетности, рассматривающийся регулятором как эквивалентные Международным стандартам финансовой отчетности, а применительно к определению Основного общества и Дочернего общества, если отсутствует отчетность, составленная в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности, означает финансовую отчетность по U.S. GAAP, РСБУ или иную общепринятую для места нахождения Дочернего общества финансовую отчетность.</p> <p>«Группа» означает, всех вместе, Эмитента, Компанию, а также подконтрольных им прямо или косвенно дочерних обществ или аффилированных лиц (включая Поручителей, кроме Компании).</p> <p>«Задолженность» означает обязательство по (или в отношении):</p> <p>(a) возврату заемных денежных средств;</p> <p>(b) уплате суммы, возникшее вследствие (i) принятия обязательств по кредиту (acceptance credit) (исключая такие обязательства, принимаемые в процессе обычной хозяйственной деятельности со сроком финансирования менее девяноста (90) дней, (ii) учета векселей, (iii), договора факторинга (исключая суммы получаемы без права обратного требования);</p>
--	--	--	---

			<p>(с) уплате суммы, возникшее вследствие договора о выпуске нот, или выпуска облигаций, нот, долговых обязательств, ценных бумаг, обеспечивающих долговые обязательства или аналогичного финансового инструмента, или вследствие выпуска акций (долей) которые могут быть погашены как в обязательном порядке, так и по требованию их владельцев;</p> <p>(d) уплате любых сумм, возникающих из обязательств по соглашениям лизинга или оплатам в рассрочку, которые, в рамках применения стандартов МСФО могут быть отнесены к финансовому лизингу или прямому лизингу;</p> <p>(e) уплате суммы, возникшее вследствие любой другой сделки (включая продажу с отсрочкой исполнения, договор купли-продажи или договор репо) эквивалентной с экономической точки зрения займу, однако исключая, во избежание сомнений, оплату по счетам поставщиков, оплату по торговым операциям и иные обязательства перед торговыми кредиторами, начисленным скидкам, полученным предоплатам от покупателей, платежи по операционной аренде, пассивные обязательства в отношении работников и обязательства перед пенсионными фондами;</p> <p>(f) уплате суммы, возникшее вследствие любой договоренности, по которой проданные или иным образом отчужденные активы лица могут быть арендованы или выкуплены таким лицом или его Аффилированным лицом (включая если такие договоренности предусматривают возможность (право) на такие действия);</p> <p>(g) деривативной сделке, заключенной в связи с защитой от или получения прибыли от колебаний ставок или цен (при определении стоимости деривативной сделки принимается во внимание исключительно ее текущая рыночная стоимость (marked to market value) (с учетом возможности неттинга и зачета как это определено в МСФО);</p> <p>(h) обязательств по возмещению потерь или иных аналогичных компенсационных обязательств по поручительству, возмещению потерь</p>
--	--	--	---

			<p>(indemnity), облигациям, аккредитивам, или иным финансовым инструментам выданным банком или финансовой организацией, в той мере, в какой такие обязательства возникают при уплате такими организациями основного обязательства и если такие возникшие обязательства остаются неисполненными по истечении применимого грэйс-периода; и</p> <p>(i) уплате суммы по поручительству (гарантии) по обязательствам, указанным выше в пунктах настоящего определения.</p> <p>Во избежание сомнений, Внутригрупповые сделки не учитываются при определении Задолженности и никакая сумма не должна дублироваться при расчете.</p> <p>«Внутригрупповая сделка» означает (a) заем, гарантию, поручительство, реорганизацию и любую другую сделку между Основным обществом и(или) Дочерним обществом, с одной стороны, и Основным обществом и(или) другим Дочерним обществом, с другой стороны; или (b) сделку Основного общества и(или) Дочернего общества в пользу Основного общества и(или) другого Дочернего общества, включая выплату дивидендов или иное распределение Дочерним обществом Основному обществу или иному Дочернему обществу.</p> <p>«Аффилированное лицо» означает, по отношению к какому-либо лицу (указанному лицу) (i) лицо, прямо или косвенно контролирующее, или контролируемое указанным лицом или (ii) лицо, являющееся директором или работником (a) такого указанного лица, (b) Дочернего общества указанного лица, или (c) лица, указанного выше в п. (i) настоящего определения. Для целей настоящего определения «контроль» в отношении лица означает владение большинством голосов на общем собрании акционеров/участников юридического лица или субъекта либо правом контроля (в том числе возможностью определять решения, принимаемые юридическим лицом или субъектом), предоставленным в соответствии с договором либо иным образом.</p>
--	--	--	--

		<p>«Проектное Финансирование без права обратного требования» означает финансирование всех или части расходов на приобретение, создание или строительство проекта, если права требования лица предоставляющего это финансирование ограничены возможностью обратиться взыскание исключительно на такой проект и соответствующую проектную компанию (предполагается что такой компанией не должно являться Основное общество или Дочернее общество), и доходы от такого проекта (что должно быть указано и согласовано в акционерных соглашениях (equity contribution agreements) и соответствующих гарантиях, субординированные долговые обязательства, спонсорские гарантии завершения проекта, обязательства по договорам поставки ресурсов производства, договорам, договорам о покупке будущей продукции (offtake agreements), договорам залога акций и иным подобным договорам, если предоставление по этим договорам осуществляют прямые или косвенные владельцы или спонсоры проекта не будут учитываться в составе такого финансирования, и рассматриваются как предоставляющие права требования в отношении Основного общества и Дочерних обществ.</p> <p>«Дата эмиссии» означает 1 февраля 2018.</p>
	Изначальная цена	Будет определена Эмитентом в отдельном решении и раскрыта в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций
2.	Дилеры-ориентиры хеджа	
2.1.	Дилер-ориентир хеджа 1	<p>полное фирменное наименование: Акционерное общество «Сбербанк КИБ» сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО «Сбербанк КИБ» для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739007768 для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо:</p>

		<p>253400JYF26KUD0RLW67 (LEI) ИНН (при наличии): 7710048970 место нахождения и адрес: Российская Федерация, 117312, г. Москва, ул. Вавилова, д. 19</p>
2.2.	Дилер-ориентир хеджа 2	<p>полное фирменное наименование: Голдман Сакс Интернешнл (Goldman Sachs International) сокращенное фирменное наименование (при наличии): Голдман Сакс Интернешнл (Goldman Sachs International) для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: W22LROWP2IHZNBB6K528 (LEI) ИНН (при наличии): не применимо место нахождения и адрес: Платри Корт 25 Шу Лейн, Лондон ИСи4А АЮ, Великобритания (Plumtree Court 25 Shoe Lane London EC4A 4AU, UK)</p>
2.3.	Дилер-ориентир хеджа 3	<p>полное фирменное наименование: Мерил Линч Интернешнл (Merrill Lynch International) сокращенное фирменное наименование (при наличии): Мерил Линч Интернешнл (Merrill Lynch International) для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: GGDZP1UYGU9STUHRDP48 (LEI) ИНН (при наличии): не применимо место нахождения и адрес: 2 Кинг Эдвард Стрит Лондон ИСи1А 1ЭйчКью, Великобритания (2 King Edward Street London EC1A 1HQ, UK)</p>
2.4.	Дилер-ориентир хеджа 4	<p>полное фирменное наименование: Джи.Пи. Морган Секьюритиз пизлси (J.P. Morgan Securities plc) сокращенное фирменное наименование (при наличии): Джи.Пи. Морган Секьюритиз пизлси (J.P. Morgan Securities plc) для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо</p>

		<p>для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32 (LEI) ИНН (при наличии): не применимо место нахождения и адрес: 25 Банк Стрит Канари Уорф Лондон, И14 5ДжиПи, Великобритания (25 Bank Street Canary Wharf London, E14 5JP, UK</p>
3.	Дилеры-ориентиры актива	
3.1.	Дилер-ориентир актива 1	<p>полное фирменное наименование: Акционерное общество «Сбербанк КИБ» сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО «Сбербанк КИБ» для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739007768 для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: 253400JYF26KUD0RLW67 (LEI) ИНН (при наличии): 7710048970 место нахождения и адрес: Российская Федерация, 117312, г. Москва, ул. Вавилова, д. 19</p>
3.2.	Дилер-ориентир актива 2	<p>полное фирменное наименование: Голдман Сакс Интернешнл (Goldman Sachs International) сокращенное фирменное наименование (при наличии): Голдман Сакс Интернешнл (Goldman Sachs International) для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: GGDZP1UYGU9STUHRDP48 (LEI) ИНН (при наличии): не применимо место нахождения и адрес: 2 Кинг Эдвард Стрит Лондон ИС1А</p>

3.3.	Дилер-ориентир актива 3	<p>1ЭйчКью, Великобритания (2 King Edward Street London EC1A 1HQ, UK)</p> <p>полное фирменное наименование: Мерил Линч Интернешнл (Merrill Lynch International)</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): Мерил Линч Интернешнл (Merrill Lynch International)</p> <p>для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо</p> <p>для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: GGDZP1UYGU9STUHRDP48 (LEI)</p> <p>ИНН (при наличии): не применимо</p> <p>место нахождения и адрес: 2 Кинг Эдвард Стрит Лондон ИС1А 1ЭйчКью, Великобритания (2 King Edward Street London EC1A 1HQ, UK)</p>
3.4.	Дилер-ориентир актива 4	<p>полное фирменное наименование: Джи.Пи. Морган Секьюритиз пиэлси (J.P. Morgan Securities plc)</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): Джи.Пи. Морган Секьюритиз пиэлси (J.P. Morgan Securities plc)</p> <p>для российских юридических лиц – ОГРН: не применимо</p> <p>для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: K6Q0W1PS1L1O4IQL9C32 (LEI)</p> <p>ИНН (при наличии): не применимо</p> <p>место нахождения и адрес: 25 Банк Стрит Канари Уорф Лондон, И14 5ДжиПи, Великобритания (25 Bank Street Canary Wharf London, E14 5JP, UK)</p>
4.	Резервные дилеры-ориентиры	
4.1.	Дилер-ориентир	<p>полное фирменное наименование: «МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК» (публичное акционерное общество)</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): ПАО «МОСКОВСКИЙ КРЕДИТНЫЙ БАНК»</p> <p>для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739555282</p> <p>для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный</p>

		<p>номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: 2534000R9X3PNNE57C55 (LEI) ИНН (при наличии): 7734202860 место нахождения и адрес: 107045, Москва, Луков переулок, д. 2, стр. 1</p>
5.	Параметры хеджирующих сделок	
5.1.	Контрагент по хеджу	<p>полное фирменное наименование: Банк ВТБ (публичное акционерное общество) сокращенное фирменное наименование (при наличии): Банк ВТБ (ПАО) для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739609391 для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: не применимо ИНН (при наличии): 7702070139 место нахождения: 190000, г. Санкт-Петербург, ул. Большая Морская, д. 29 адрес: 109147, г. Москва, ул. Воронцовская, д. 43, стр. 1</p>
5.2.	Существенные условия Хеджирующей сделки 1	В соответствии с Приложением 2
5.3.	Существенные условия Хеджирующей сделки 2	В соответствии с Приложением 4
6.	Валютный коэффициент	<p>Валютный коэффициент равен отношению величины Курс1 к величине Курс0, где</p> <p>Курс0 – Обменный курс российского рубля к евро по состоянию на следующий рабочий день после даты окончания срока для направления оферт потенциальных приобретателей Облигаций с предложением заключить предварительные договоры о приобретении Облигаций в рамках размещения;</p> <p>Курс1 - Обменный курс российского рубля к евро по состоянию на последний рабочий день, предшествующий дате исполнения обязательств по Облигациям, для определения размера которых используется значение Валютного коэффициента в соответствии с решением о выпуске Облигаций.</p> <p>Обменный курс российского рубля к евро – курс рубля к евро, выраженный как количество рублей за один евро, определенный</p>

Контрагентом по хеджу следующим образом:
(А) как курс фиксинга евро/российский рубль Московской Биржи (EURFIXME), опубликованный в день, по состоянию на который требуется установить значение Курс0 или Курс1, на странице ПАО Московская Биржа в сети Интернет (<https://www.moex.com/ru/markets/currency/get-fixing.aspx?code=EURFIXME>);

или если Обменный курс российского рубля к евро не может быть определён в соответствии с пунктом (А) выше, то

(Б) как курс евро, опубликованный Банком России в дату, на которую необходимо определить значение Обменного курса российского рубля к евро;

или если Обменный курс российского рубля к евро не может быть определён в соответствии с пунктами (А) и (Б) выше, то

(В) как кросс-курс на основе курса евро к доллару США BFIX SPOT и курса доллара США к российскому рублю RUB MOEX, опубликованные в день, по состоянию на который требуется установить значение Курс0 или Курс1.

BFIX SPOT означает курс доллара США к евро, выраженный как количество долларов США за один евро, для расчетов через два Рабочих дня, рассчитанный Bloomberg Finance L.P. и объявляемый в системе Bloomberg Professional на странице «EUR L100 Curncy HP» в колонке «Last Price» в 10 часов по времени г. Лондон (Великобритания) в день, по состоянию на который требуется установить значение Курс0 или Курс1.

RUB MOEX, курс фиксинга доллар США/российский рубль Московской Биржи (USDFIXME), опубликованный в дату платежа, на странице ПАО Московская Биржа в сети Интернет (<https://www.moex.com/ru/markets/currency/get-fixing.aspx?code=USDFIXME>);

или если Обменный курс российского рубля к евро не может быть определён в соответствии с пунктами (А), (Б) и (В) выше, то

(Г) Контрагент по хеджу обязан в дату, по состоянию на которую

		<p>необходимо определить установить значение Курс0 или Курс1, запросить оферты у не менее чем четырех банков, выбранных Контрагентом по хеджу из числа ведущих на рынке соответствующих валют, на покупку евро у Контрагента по хеджу.</p> <p>Оферты, используемые для определения курса согласно пункту (Г), должны содержать цену приобретения у Контрагента по хеджу евро в размере, равном обычной сумме для конверсионных сделок спот на рынке евро, при этом указанная цена должна быть определена во время дня, указанное Контрагентом по хеджу.</p> <p>Обменный курс российского рубля к евро определяется как среднее арифметическое цен, указанных в офертах не менее чем четырех банков, выбранных Контрагентом по хеджу из числа ведущих на рынке соответствующих валют, полученных в дату запроса оферт, без учета самого высокого и самого низкого значений (если более одной котировки имеют одинаковое самое высокое или низкое значения, не учитывается только одна из этих котировок).</p> <p>Если предоставлены менее четырёх оферт от банков, выбранных Контрагентом по хеджу из числа ведущих на рынке соответствующих валют, то Обменный курс российского рубля к евро определяется как среднее арифметическое цен за единицу валюты, указанных в офертах, полученных в дату запроса оферт.</p>
7.	<p>Размер дополнительного дохода либо порядок определения размера дополнительного дохода</p>	<p>Размер дополнительного дохода по Облигациям, подлежащего выплате в каждую Дату выплаты, исчисляется по ставке, определяемой в указанном ниже порядке, с поправкой на Валютный коэффициент.</p> <p>Расчёт суммы дополнительного дохода на одну Облигацию производится по следующей формуле:</p> $ДД = C * Nom * (T - T_0) / 365 * F_x,$ <p>ДД – сумма выплаты дополнительного дохода в расчёте на одну Облигацию, в российских рублях;</p> <p>С – процентная ставка в процентах годовых, значение которой будет определено Эмитентом в отдельном решении и раскрыто в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций;</p> <p>Nom – номинальная стоимость одной Облигации, в российских рублях;</p> <p>T – Дата выплаты;</p>

		<p>T0 – Дата выплаты, предшествующая Дате выплаты, на которую осуществляется расчет размера дополнительного дохода; для расчета размера дополнительного дохода для первой Даты выплаты T0 – дата начала размещения Облигаций;</p> <p>Fx – Валютный коэффициент.</p> <p>Величина дополнительного дохода рассчитывается с точностью до одной копейки (округление производится в меньшую сторону, т.е. значение целой копейки (целых копеек) не изменяется, вне зависимости от того, какая цифра стоит после первой за округляемой). Если величина дополнительного дохода меньше одной копейки, то в таком случае дополнительный доход на одну Облигацию считается равным одной копейке.</p>
8.	Даты выплаты	<p>22.02.2021</p> <p>20.08.2021</p> <p>22.02.2022</p> <p>22.08.2022</p> <p>10.03.2023</p>
9.	Плановая дата погашения	10.03.2023
10.	Предельная дата погашения	10.03.2026
11.	Расчётный агент	<p>полное фирменное наименование: Акционерное общество ВТБ Капитал АО ВТБ Капитал</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО ВТБ Капитал для российских юридических лиц – ОГРН: 1067746393780</p> <p>для иностранных юридических лиц – международный код идентификации юридического лица (LEI) или иной идентификационный номер юридического лица, присвоенный такому лицу в соответствии с личным законом юридического лица, с указанием наименования идентифицирующего номера, если применимо: не применимо</p> <p>ИНН (при наличии): 7703585780</p> <p>место нахождения и адрес: 123112, г. Москва, Пресненская наб., д. 12, этаж 32, кабинет 32.30, этаж 20, кабинет 20.31а</p>
12.	Порядок определения размера выплат при погашении в случае, если на Плановую дату оценки имеет место Кредитное событие (применимость Суммы расчёта)	Применяется Сумма расчёта
13.	Порядок определения размера выплат при досрочном погашении в случае наступления Кредитного события (применимость Суммы расчёта)	Применяется Сумма расчёта

Подтверждение по Сделке валютно-процентный своп

[] 2020 года

ООО СФО ВТБ Инвестиционные Продукты

119435, Российская Федерация, г. Москва, Большой Саввинский переулок, дом 10, строение 2А, этаж 2, офис 2 (202)

Кас.: Подтверждения по Сделке валютно-процентный своп, регистрационный номер _____

Уважаемые господа!

Целью настоящего письма (далее — *«Подтверждение»*) является подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между **БАНКОМ ВТБ (ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО)** (далее — *«Сторона А»*) и **ОБЩЕСТВОМ С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ СПЕЦИАЛИЗИРОВАННОЕ ФИНАНСОВОЕ ОБЩЕСТВО ВТБ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ПРОДУКТЫ** (далее — *«Сторона Б»*) от 15 июня 2020 г. (далее — *«Генеральное соглашение»*).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок на процентные ставки, сделок валютно-процентный своп и сделок свопцион 2011 г. (далее — *«Стандартные условия»*), разработанных и утвержденных Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на странице Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР). В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.
3. Условия Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, составляют:
 - (а) Общие условия:

Номинальная сумма и валюта для Стороны А:

[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до

начала размещения Облигаций]

Номинальная сумма и валюта для Стороны Б: [Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]

Дата сделки: 3 августа 2020 года

Дата начала срока: 4 августа 2020 года

Дата истечения срока: 9 марта 2023 года

(б) Фиксированные суммы в долларах США:

Плательщик Фиксированных сумм в долларах США: Сторона Б

Даты начала Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в долларах США: В соответствии с Приложением 3

Даты окончания Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в долларах США: В соответствии с Приложением 3

Даты платежа Фиксированных сумм в долларах США: В соответствии с Приложением 3

Фиксированные суммы в долларах США: В соответствии с Приложением 3

Фиксированная ставка в долларах США: 4.85% годовых

Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для фиксированной ставки в долларах США: 30 / 360

(в) Фиксированные суммы в евро:

Плательщик Фиксированных сумм в евро: Сторона А

Дата начала Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в евро: В соответствии с Приложением 3

Дата окончания Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в евро: В соответствии с Приложением 3

	Даты платежа Фиксированных сумм в евро:	В соответствии с Приложением 3
	Фиксированные суммы в евро:	В соответствии с Приложением 3
	Фиксированная ставка в евро:	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
	Коэффициент для расчета дней в процентном периоде для фиксированной ставки в евро:	ACT / 365
(г)	Первоначальный платеж:	Не применимо
(д)	Промежуточные платежи:	Не применимо
(е)	Окончательный платеж:	Применимо
	Дата окончательного платежа:	Дата истечения срока
	Сумма окончательного платежа для Стороны А:	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
	Сумма окончательного платежа для Стороны Б:	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
(ж)	Амортизация Номинальной суммы:	Не применимо

4. **Дополнительные условия:**

1) Платежи всех сумм, выраженных в евро, осуществляются в российских рублях по Обменному курсу российского рубля к евро.

Обменный курс российского рубля к евро – курс рубля к евро, выраженный как количество рублей за один евро, определенный Расчетным агентом следующим образом:

(А) как курс фиксинга евро/российский рубль Московской Биржи (EURFIXME), опубликованный в Дату платежа, на странице ПАО Московская Биржа в сети Интернет (<https://www.moex.com/ru/markets/currency/get-fixing.aspx?code=EURFIXME>); или если Обменный курс российского рубля к евро не может быть определен в соответствии с пунктом (А) выше, то

(Б) как курс евро, опубликованный Банком России в Дату платежа, если Обменный курс российского рубля к евро не может быть определен в соответствии с пунктами (А) и (Б) выше, то

(В) как кросс-курс на основе курса евро к доллару США BFIX SPOT и курса доллара США к российскому рублю RUB MOEX, опубликованных в Дату платежа.

BFIX SPOT означает курс доллара США к евро, выраженный как количество долларов США за один евро, для расчетов через два Рабочих дня, рассчитанный Bloomberg Finance L.P. и объявляемый в системе Bloomberg Professional на странице «EUR L100 Currency HP» в колонке «Last Price» в 10 часов по времени г. Лондон (Великобритания) в Дату платежа.

RUB MOEX, курс фиксинга доллар США/российский рубль Московской Биржи (USDFIXME), опубликованный в дату платежа, на странице ПАО Московская Биржа в сети Интернет (<https://www.moex.com/ru/markets/currency/get-fixing.aspx?code=USDFIXME>); или если Обменный курс российского рубля к евро не может быть определен в соответствии с пунктами (А), (Б) и (В) выше, то

(Г) Расчетный агент обязан в дату, по состоянию на которую необходимо определить значение Обменного курса российского рубля к евро, запросить не менее четырех оферт (твердых котировок) у Банков-ориентиров на покупку евро у Расчетного агента.

Оферты, используемые для определения курса согласно пункту (Г), должны содержать цену приобретения у Расчетного агента евро в размере, равном обычной сумме для конверсионных сделок спот на рынке евро, при этом указанная цена должна быть определена во время дня, указанное Расчетным агентом.

Обменный курс российского рубля к евро определяется как среднее арифметическое цен, указанных в офертах Банков-ориентиров, полученных в дату запроса оферт, без учета самого высокого и самого низкого значений (если более одной котировки имеют одинаковое самое высокое или низкое значения, не учитывается только одна из этих котировок).

Если предоставлены менее четырех оферт Банков-ориентиров, то Обменный курс российского рубля к евро определяется как среднее арифметическое цен за единицу валюты, указанных в офертах, полученных в дату запроса оферт.

2) В случае наступления События дефолта положения о прекращении, предусмотренные Примерными условиями договора и Генеральным соглашением не применяются, обязательства Сторон по Сделке прекращаются в дату уплаты обязанной Стороной Суммы прекращения (далее – Дата прекращения Сделки) при условии уплаты обязанной Стороной Суммы прекращения в 22 (Двадцать второй) Рабочий день, следующий за датой наступления События дефолта.

Сумма прекращения определяется следующим образом:

Сумма прекращения = $\text{Min}(NPV; Recovery)$

NPV означает Текущую справедливую стоимость Гипотетической сделки хеджирования (как этот термин определен в Решении о выпуске ценных бумаг Общества с ограниченной ответственностью Специализированное финансовое общество ВТБ Инвестиционные Продукты структурных облигаций серии 03, регистрационный номер 6-03-00545-R от 09.07.2020 (далее – «Решение»)) на Дату прекращения Сделки, взятую для целей расчета Суммы прекращения с обратным знаком.

Recovery означает произведение Окончательной цены (как этот термин определен в Решении) и Номинальной стоимости облигаций (как этот термин определен в Подтверждении по сделке поставочный форвард на облигации, регистрационный номер _____, заключенной между Стороной А и Стороной Б).

В случае, если Сумма прекращения имеет положительное значение, Сторона Б является обязанной Стороной и обязуется уплатить Сумму прекращения Стороне А. Если Сумма прекращения имеет отрицательное значение, Сторона А является обязанной стороной и обязуется уплатить абсолютное значение Суммы прекращения Стороне Б.

Событие дефолта означает любое из следующих событий:

- (а) **Кредитное событие**, как этот термин определен в Решении.
- (б) **Событие дестабилизации**, как этот термин определен в Решении.
- (в) Наступление События дефолта не является Дополнительным основанием прекращения для целей пункта 3.6 статьи 3 Генерального соглашения.

(г) Положения настоящего пункта 4 являются существенными условиями Сделки, и без включения этих положений Сделка не была бы заключена Сторонами.

5. Расчетный агент: Сторона А.

6. Банковские реквизиты:

Счет для платежей в пользу Стороны А:

Для расчетов в долларах США (при переводе денежных средств со счетов, открытых в Банке ВТБ (ПАО)):

ИНН 7702070139

БИК 044525187

Расчетный счет 47408840600210000103 в Банке ВТБ (ПАО) г. Москва

SWIFT: VTBRRUMM

Для расчетов в долларах США (при переводе денежных средств со счетов, открытых в других банках):

Citibank NA, New York (CITI US 33)

Account Number: 36208997

Счет для платежей в пользу Стороны Б:

Для расчетов в рублях:

р/с: 40701810903800000180

в Банке ВТБ (ПАО)

к/с: 30101810700000000187

БИК: 044525187

7. Рабочий день: Москва (Россия), Нью-Йорк (США)

8. Условие об окончании срока в нерабочий день: Следующий рабочий день.

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

Банк ВТБ (ПАО)

Ф. И. О.:

На основании доверенности № от

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

ООО СФО ВТБ Инвестиционные продукты

Ф. И. О.:

Приложение № 3
к Приказу № 06/02/2020/SFO VTB IP
Директора
Общества с ограниченной ответственностью «Тревеч - Управление»
от 17.07.2020

Номер периода	Дата начала Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в долларах США	Дата окончания Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в долларах США	Дата платежа Фиксированных сумм в долларах США	Дата начала Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в евро	Дата окончания Процентного периода в отношении Фиксированных сумм в евро	Дата платежа Фиксированных сумм в евро	Фиксированные суммы в евро	Фиксированные суммы в долларах США
1	01.08.2020	01.02.2021	19.02.2021	04.08.2020	22.02.2021	19.02.2021	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
2	01.02.2021	01.08.2021	19.08.2021	22.02.2021	20.08.2021	19.08.2021	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
3	01.08.2021	01.02.2022	18.02.2022	20.08.2021	22.02.2022	21.02.2022	[Данный параметр будет определён	[Данный параметр будет определён

							Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]	Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
4	01.02.2022	01.08.2022	19.08.2022	22.02.2022	22.08.2022	19.08.2022	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
5	01.08.2022	01.02.2023	09.03.2023	22.08.2022	10.03.2023	09.03.2023	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]

Приложение № 4
к Приказу № 06/02/2020/SFO VTB IP
Директора
Общества с ограниченной ответственностью «Тревеч - Управление»
от 17.07.2020

Подтверждение для Сделки поставочный форвард на облигации

[] 2020 г.

ООО СФО ВТБ Инвестиционные Продукты

119435, Российская Федерация, г. Москва, Большой Саввинский переулок, дом 10, строение 2А, этаж 2, офис 2 (202)

Кас.: Сделки поставочный форвард на облигации, номер сделки _____

Уважаемые Господа!

Целью настоящего письма (далее — **«Подтверждение»**) является Подтверждение условий Сделки, заключенной нами в указанную ниже Дату сделки. Настоящее Подтверждение представляет собой Подтверждение в смысле Генерального соглашения о срочных сделках на финансовых рынках между **БАНКОМ ВТБ (ПУБЛИЧНОЕ АКЦИОНЕРНОЕ ОБЩЕСТВО)** (далее – **«Сторона А»**) и **ОБЩЕСТВОМ С ОГРАНИЧЕННОЙ ОТВЕТСТВЕННОСТЬЮ СПЕЦИАЛИЗИРОВАННОЕ ФИНАНСОВОЕ ОБЩЕСТВО ВТБ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ПРОДУКТЫ** (далее – **«Сторона Б»**) от 15 июня 2020 г. (далее — **«Генеральное соглашение»**).

1. В настоящее Подтверждение включены положения Стандартных условий срочных сделок с облигациями 2011 г. с изменениями и дополнениями, внесенными Протоколом 2013 г. Об иностранных облигациях к Стандартным условиям срочных сделок с облигациями 2011 г. (далее — **«Стандартные условия»**), разработанные и утвержденные Саморегулируемой (некоммерческой) организацией «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР), Национальной Валютной Ассоциацией и Ассоциацией российских банков, опубликованные в сети Интернет на странице Саморегулируемой (некоммерческой) организации «Национальная ассоциация участников фондового рынка» (НАУФОР). В случае противоречия между настоящим Подтверждением и положениями указанных Стандартных условий настоящее Подтверждение имеет преимущественную силу.
2. Настоящее Подтверждение дополняет Генеральное соглашение, является его частью и регулируется Генеральным соглашением. Все положения Генерального соглашения применяются к настоящему Подтверждению, если иное не предусмотрено ниже.
3. Условиями Сделки, к которой относится настоящее Подтверждение, являются:

(а) Общие условия:

Дата сделки:	3 августа 2020 г.
Продавец:	Сторона А
Покупатель:	Сторона Б
Облигации:	<p>Полное наименование: РУСАЛ Плс, 4.85% 1feb2023</p> <p>Категория (тип): Еврооблигация</p> <p>ISIN: XS1759468967</p> <p>Полное фирменное наименование Эмитента Облигаций: Русал Кэпитал ДиЭйСи (Rusal Capital D.A.C.)</p>
Номинальная стоимость облигаций:	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
Форвардная цена	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
Биржа	Irish Stock Exchange
Дополнительное условие:	<p>Сторона Б осуществляет предоплату Форвардной цены в Дату расчетов для Стороны Б.</p> <p>На такую сумму предоплаты осуществляется начисление процентов по Процентной ставке.</p> <p>Сторона А осуществляет выплату процентов в размере Суммы процентных платежей в Даты процентных платежей.</p>
Процентная ставка:	4.85% годовых
Даты начала Процентного периода:	В соответствии с Приложением 5
Даты окончания Процентного периода:	В соответствии с Приложением 5
Суммы процентных платежей:	В соответствии с Приложением 5
Даты процентных платежей:	В соответствии с Приложением 5
(б) Условия осуществления расчетов:	
Расчеты в порядке, установленном для Поставочной сделки:	Применимо

Валюта платежа:	Доллары США
Дата расчетов для Стороны А:	31 января 2023 г.
Дата расчетов для Стороны Б:	5 августа 2020 г.
Промежуточные платежи:	Не применимо
Условие об окончании срока в нерабочий день применительно к Дате расчетов:	Предшествующий рабочий день
Условие об окончании срока в нерабочий день в иных случаях:	Следующий рабочий день
Рабочий день применительно к Дате расчетов:	Москва (Россия), Лондон (Великобритания)
Рабочий день в иных случаях:	Москва (Россия), Нью-Йорк (США)

4. **Дополнительное условие.** В случае наступления События дефолта Сторона А обязуется исполнить обязательства по Сделке не позднее 35-го (тридцать пятого) Рабочего дня, следующего за датой наступления События дефолта. При этом Дата расчетов для Стороны А изменяется на Рабочий день в течение указанного периода, определенный по выбору Стороны А.

В случае наступления События дефолта исполнение обязательств по поставке Стороной А Облигаций осуществляется путем выплаты Стороной А в пользу Стороны Б денежного эквивалента в сумме денежных средств, равной произведению Окончательной цены (как этот термин определен в Решении о выпуске ценных бумаг Общества с ограниченной ответственностью Специализированное финансовое общество ВТБ Инвестиционные Продукты структурных облигаций серии 03, регистрационный номер 6-03-00545-R от 09.07.2020 (далее – «Решение»)) и Номинальной стоимости облигаций.

Все обязательства (кроме обязательства по поставке Облигаций) Сторон, дата исполнения которых в соответствии с условиями Сделки наступает после наступления События дефолта, если таковые имеются, прекращаются автоматически и полностью в дату наступления События дефолта.

Событие дефолта означает любое из следующих событий:

- (а) **Кредитное событие**, как этот термин определен в Решении.
- (б) **Событие дестабилизации**, как этот термин определен в Решении.

Наступление События дефолта не является Дополнительным основанием прекращения для целей пункта 3.6 статьи 3 Генерального соглашения.

Положения настоящего пункта 4 являются существенными условиями Сделки, и без включения этих положений Сделка не была бы заключена Сторонами

5. Расчетный агент: Сторона А.

6. Реквизиты для платежей и поставок:

Реквизиты для платежей в пользу Стороны А:

Для расчетов в рублях:

Расчетный счет 47408810900210035594
Корреспондентский счет 3010181070000000187 в ГУ Банка России по ЦФО
БИК 044525187
ИНН 7702070139
Полное наименование банка: Банк ВТБ (ПАО) г. Москва
СВИФТ банка получателя VTBRRUMM

Для расчетов в долларах США:

Расчетный счет: 47408840200210035594 в Банке ВТБ (ПАО) г. Москва
ИНН 7702070139
Swift Code: VTBRRUMM

Реквизиты для платежей в пользу Стороны Б:

Для расчетов в долларах США:

Расчетный счет 40701840403800000058

Транзитный валютный счет 40701840703800000059

в Банке ВТБ (ПАО)

БИК: 044525187

к/с: 3010181070000000187

Для расчетов в рублях:

Расчетный счет 40701810903800000180 в Банке ВТБ (ПАО)

БИК: 044525187

к/с: 3010181070000000187

Для расчетов по ценным бумагам:

Для Стороны А:

Счет HS1212170398, Раздел 31MC0003300000F00, Идентификатор MC0003300000

Для Стороны Б:

Счет депо №А259 для учета собственных ценных бумаг в Депозитарии Банка ВТБ (ПАО)

Настоящее Подтверждение отменяет и заменяет собой любую предшествующую переписку между нами в отношении настоящей Сделки (в том числе по Электронным средствам связи).

Просим подтвердить, что вышеизложенное правильно отражает условия Сделки, подписав и вернув нам приложенную копию настоящего Подтверждения.

С уважением,

СТОРОНА Б

Ф. И. О.: []
Должность: []

Подтверждено по состоянию на дату, указанную на первой странице:

СТОРОНА А

Ф. И. О.: []
Должность: []

Приложение № 5
к Приказу № 06/02/2020/SFO VTB IP
Директора
Общества с ограниченной ответственностью «Тревеч - Управление»
от 17.07.2020

Дата начала процентного периода	Дата окончания процентного периода	Дата процентного платежа	Сумма процентного платежа, долларов США
01.08.2020	01.02.2021	19.02.2021	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
01.02.2021	01.08.2021	19.08.2021	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
01.08.2021	01.02.2022	18.02.2022	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
01.02.2022	01.08.2022	19.08.2022	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]
01.08.2022	01.02.2023	09.03.2023	[Данный параметр будет определён Эмитентом в отдельном решении и раскрыт в отдельном сообщении, которое должно быть опубликовано Эмитентом до начала размещения Облигаций]

