

ПРИКАЗ № 1-2

О внесении изменений в определение ключевых условий выпуска по структурным облигациям Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество Румберг Структурные Продукты» серии СП-1-2

г. Москва

18.06.2024

В соответствии с решением о выпуске структурных процентных или дисконтных неконвертируемых бездокументарных облигаций Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество Румберг Структурные Продукты» с залоговым обеспечением серии СП-1-2, регистрационный номер 6-02-00761-R-001P от 06.05.2024,

ПРИКАЗЫВАЮ

Внести изменения в приказ № 1 от 28.05.2024 и определить числовые значения, параметры, условия и (или) порядок их определения в соответствии с Приложением 1 к настоящему Приказу.

Генеральный директор Общества с ограниченной ответственностью «Румберг Кэпитал», осуществляющего функции единоличного исполнительного органа Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество Румберг Структурные Продукты» на основании договора передачи полномочий единоличного исполнительного органа от 18.10.2023



Решение о ключевых условиях выпуска структурных облигаций процентных или дисконтных неконвертируемых бездокументарных серии СП-1-2 с залоговым обеспечением (далее – «Облигации»)

Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество Румберг Структурные Продукты» (далее – «Эмитент»)

ЦЕННЫЕ БУМАГИ, СОСТАВЛЯЮЩИЕ НАСТОЯЩИЙ ВЫПУСК, ЯВЛЯЮТСЯ ЦЕННЫМИ БУМАГАМИ, ПРЕДНАЗНАЧЕННЫМИ ДЛЯ КВАЛИФИЦИРОВАННЫХ ИНВЕСТОРОВ, И ОГРАНИЧЕНЫ В ОБОРОТЕ В СООТВЕТСТВИИ С ЗАКОНОДАТЕЛЬСТВОМ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Настоящее Решение о ключевых условиях выпуска принимается Эмитентом в соответствии с положениями Программы и соответствующего Решения о выпуске (далее совместно – «Эмиссионная документация») и включает информацию об условиях и параметрах выпуска Облигаций, ссылка на которые содержится в Эмиссионной документации. Зарегистрированные копии Программы и Решения о выпуске могут быть предоставлены Эмитентом по запросу заинтересованного лица.

Термины, содержащиеся в настоящем документе, если прямо не указано иное, имеют значение, установленное в Программе и Решении о выпуске.

1 ПАРАМЕТРЫ ОБЛИГАЦИЙ	
ISIN	RU000A108F71
Валюта номинальной стоимости Облигаций	Рубли РФ
Валюта, в которой осуществляются расчеты при размещении Облигаций	Рубли РФ
Валюта, в которой осуществляются выплаты по Облигациям	Рубли РФ
Номинальная стоимость одной Облигации	1 000 рублей РФ
Цена размещения Облигации	150 (сто пятьдесят) рублей 00 копеек за Облигацию (15 % от номинальной стоимости Облигации)
Период размещения Облигаций	02.07.2024 – 05.07.2024
Плановая дата погашения Облигаций	06.07.2027
Инвестор(ы)	Определяются как физические и юридические лица, являющиеся квалифицированными инвесторами, имеющие право приобретать Облигации в соответствии с законодательством Российской Федерации.
Порядок размещения	Размещение на организованных торгах, проводимых ПАО Московская Биржа, ОГРН: 1027739387411

2 БАЗОВЫЙ АКТИВ

Базовый актив	Наименование (описание) Индекса	ISIN	Вес	Страница Индекса	Администратор индекса	Тип котировки для определения Значения	Дата оценки Первоначального значения
	Румберг Банковский Сектор	RU000A108JP6	–	https://index.rumberg.ru/rumban-ks	Акционерное общество «Румберг Технолоджис», ОГРН: 1237700069420	–	03.07.2024
Первоначальное значение	Значение Базового актива в Дату оценки Первоначального значения, определенное в порядке, предусмотренном в разделе «Порядок определения Значения Базового актива».						
Порядок определения Значения Базового актива	<p>Определяется как значение Индекса на соответствующий Торговый день, опубликованное на Странице Индекса.</p> <p>Если Дата оценки наступает в день, который не является Торговым днем, Датой оценки считается следующий ближайший Торговый день</p>						
Показатель базового актива	Определяется как величина в процентах, равная отношению Значения Базового актива на каждую Дату оценки к Первоначальному значению.						
Биржа срочных контрактов	Не применимо						
Стоимость Облигации (в % от номинальной стоимости), при недостижении которой Событие дестабилизации считается наступившим при наступлении Основания дестабилизации	1 000 % от номинальной стоимости Облигации.						

3 КУПОННЫЙ ДОХОД ПО ОБЛИГАЦИЯМ									
Размер процентной ставки купонного дохода	Так как Облигации размещаются по цене ниже их номинальной стоимости, купонный доход по Облигациям не выплачивается, а процентная ставка не определяется.								
4 ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЙ ДОХОД ПО ОБЛИГАЦИЯМ									
Даты оценки и Даты выплаты Дополнительного дохода	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 10%;">№</th> <th style="width: 30%;">Дата оценки</th> <th style="width: 30%;">Дата выплаты</th> <th style="width: 30%;">Барьер дополнительного дохода</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">1</td> <td style="text-align: center;">29.06.2027</td> <td style="text-align: center;">06.07.2027</td> <td style="text-align: center;">Не применим</td> </tr> </tbody> </table>	№	Дата оценки	Дата выплаты	Барьер дополнительного дохода	1	29.06.2027	06.07.2027	Не применим
	№	Дата оценки	Дата выплаты	Барьер дополнительного дохода					
1	29.06.2027	06.07.2027	Не применим						
Условие выплаты Дополнительного дохода	Барьер дополнительного дохода не применим, что означает, что Барьер дополнительного дохода всегда достигается в Дату оценки.								
Барьер дополнительного дохода	Не применим.								
Порядок определения размера Дополнительного дохода	<p>Сумма Дополнительного дохода на одну Облигацию рассчитывается по следующей формуле:</p> $ДД = Nom \times \frac{Max\left[\frac{P_{фин} * 100\% - K}{P_{нач}}; 0\right]^1}{100\%}, \text{ где:}$ <p><i>ДД</i> – сумма Дополнительного дохода на одну Облигацию, округлённая до 2 знаков после запятой, в рублях;</p> <p><i>Nom</i> – номинал одной Облигации, в рублях;</p> <p><i>K</i> – страйк, равен 100%;</p> <p><i>P_{фин}</i> – Значение Базового актива в Предельную дату оценки;</p> <p><i>P_{нач}</i> – Первоначальное значение Базового актива.</p>								
Выплата Дополнительного дохода при досрочном погашении по требованию владельцев облигаций	Не выплачивается								
Выплата Дополнительного дохода в случае наступления События дестабилизации	<p>Владельцы Облигаций имеют право на получение Дополнительного дохода в Дату выплаты при условии отсутствия События дестабилизации в дату, наступающую за 2 (два) Рабочих дня до Даты выплаты, и в любую более раннюю дату.</p> <p><u>После наступления События дестабилизации Дополнительный доход не выплачивается.</u></p>								

¹ – функция «Max», используемая в формуле, приводит к наибольшему значению из тех элементов функции, которые заключены в квадратные скобки, непосредственно следующие после функции «Max» и разделены точкой с запятой.

5 УСЛОВИЯ ПОГАШЕНИЯ ОБЛИГАЦИЙ				
Условия досрочного погашения				
Обстоятельства, от наступления или ненаступления которых зависит досрочное погашение Облигаций	Наступление Барьера отзыва		События дестабилизации	
	Применимо		Применимо	
Барьер отзыва	Барьер отзыва считается достигнутым если в Дату оценки значение Показателя базового актива выше Барьера отзыва или равно Барьеру отзыва.			
Даты оценки и Даты досрочного погашения в связи с наступлением Барьера отзыва	Порядковый номер	Дата оценки	Дата досрочного погашения	Барьер отзыва
	1	08.07.2024	23.07.2024	10 000%
Размер выплат при досрочном погашении Облигаций, если в день, наступающий за 2 (два) Рабочих дня до даты досрочного погашения Облигаций, НЕ наступило Событие дестабилизации, в проценте от номинальной стоимости Облигаций	Порядковый номер	Дата оценки	Размер выплаты, в % от номинальной стоимости Облигаций	
	1	08.07.2024	0.01%	
Условия погашения в Плановую дату погашения				
Обстоятельства, от наступления или ненаступления которых зависит осуществление выплат по Облигациям	Наступление Барьера погашения		События дестабилизации	
	Не применимо		Применимо	
Предельная дата оценки	29.06.2027			
Барьер погашения	Барьер погашения не применим, что означает, что Барьер погашения никогда не достигается.			
Порядок расчета размера выплаты при погашении Облигаций в случае недостижения Барьера погашения	Сумма выплаты на одну Облигацию при погашении, если Барьер погашения не достигнут, равна 0 (нулю).			

6 ИНЫЕ СВЕДЕНИЯ ПО ОБЛИГАЦИЯМ	
Дата приобретения Облигаций по соглашению с владельцами	Отсутствует
Цена приобретения Облигаций по соглашению с владельцами	Не применимо
Сумма, выплачиваемая владельцам Облигаций при досрочном погашении по требованию их владельцев	Аналогично Событию дестабилизации
Возможность частичного досрочного погашения Облигаций по усмотрению Эмитента	Не предусмотрена
Расчётный агент	<p>полное фирменное наименование: Общество с ограниченной ответственностью «Масару Инвестиции»</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): ООО «Масару Инвестиции»</p> <p>ОГРН (при наличии) и (или) 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: 1227700690480 (ОГРН)</p> <p>место нахождения и адрес: Российская Федерация, г. Москва, 111524, г. Москва, ул. Электродная, д. 2, стр. 34, помещ. 19/3, офис 24</p>

<p>Дилеры-ориентиры</p>	<p><u>Дилер-ориентир 1:</u></p> <p>полное фирменное наименование: Банк ВТБ (публичное акционерное общество)</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): Банк ВТБ (ПАО)</p> <p>для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739609391</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 типа идентифицирующего номера: 253400V1H6ART1UQ0N98 (LEI)</p> <p>ИНН (при наличии): 7702070139</p> <p>место нахождения и адрес: Российская Федерация, г. Санкт-Петербург, 191144, г. Санкт-Петербург, Дегтярный переулок, д. 11, лит. А</p>
	<p><u>Дилер-ориентир 2:</u></p> <p>полное фирменное наименование: Акционерное общество «Сбербанк КИБ»</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО «Сбербанк КИБ»</p> <p>для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739007768</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 типа идентифицирующего номера: 253400JYF26KUD0RLW67 (LEI)</p> <p>ИНН (при наличии): 7710048970</p> <p>место нахождения и адрес: Российская Федерация, г. Москва, 117312, г. Москва, ул. Вавилова, д. 19</p>

	<p><u>Дилер-ориентир 3:</u></p> <p>полное фирменное наименование: Акционерное общество «Инвестиционный Банк «ФИНАМ»</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО «Банк ФИНАМ»</p> <p>для российских юридических лиц – ОГРН: 1037739001046</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 типа идентифицирующего номера: 253400MSF9T7H1BA5P54 (LEI)</p> <p>ИНН (при наличии): 7709315684</p> <p>место нахождения и адрес: Российская Федерация, г. Москва, 127006, город Москва, Настасьинский переулок, дом 7, строение 2.</p>
<p>Депозитарий / лицо, осуществляющее выплаты по Облигациям</p>	<p>НКО АО НРД</p>
<p>Вторичное обращение</p>	<p>Обращение на организованных торгах, проводимых ПАО Московская Биржа, ОГРН: 1027739387411</p>
<p>Применимость положений секции 871 (m) Налогового кодекса США к доходу по Облигациям</p>	<p>Не применимы. Основание:</p> <ul style="list-style-type: none"> <input checked="" type="checkbox"/> Все Базовые активы (один или несколько) не является/не являются американским(и) <input type="checkbox"/> Все Базовые активы (один или несколько), либо некоторые из Базовых активов является/являются американским(и), но не является/являются акцией(ями) или индексом(ами) акций <input type="checkbox"/> Все или некоторые Базовые активы (один или несколько) является/являются американским(и) индексом(ами) акций широкого рынка <input type="checkbox"/> Все или некоторые Базовые активы (один или несколько) является/являются американской(ими) акцией(ями) или американским(и) индексом(ами) акций, но значение дельта меньше 0.8