

ПРИКАЗ № 1

*об определении ключевых условий выпуска по структурным облигациям
Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное
финансовое общество Румберг Структурные Продукты» серии СП-1-4*

г. Москва

10.07.2024

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-1-4, регистрационный номер 6-04-00761-R-001P от 06.05.2024,

ПРИКАЗЫВАЮ

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-1-4 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	RU000A108F97
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	1 000 (одна тысяча) рублей 00 копеек за Облигацию (100 % от номинальной стоимости Облигации)
Период размещения Облигаций	05.08.2024 – 07.08.2024
Плановая дата погашения Облигаций	03.08.2026
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 Технологический Сектор_ПДН_Д	RU000A108Y37	–	https://index.rumberg.ru/rtechtrd	Акционерное общество «Румберг Технолоджис», ОГРН: 1237700069420	–	06.08.2024
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	<p>0,00000001 % годовых</p> <p>Сумма купонного дохода рассчитывается по размеру процентной ставки купонного дохода за купонный период от номинальной стоимости одной Облигации, но не менее 1 копейки на одну Облигацию</p>			
4 ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЙ ДОХОД ПО ОБЛИГАЦИЯМ				
Даты оценки и Даты выплаты Дополнительного дохода	№	Дата оценки	Дата выплаты	Барьер дополнительного дохода
	1	05.11.2024	20.11.2024	105 %
	2	03.02.2025	18.02.2025	105 %
	3	05.05.2025	20.05.2025	105 %
	4	04.08.2025	19.08.2025	105 %
	5	03.11.2025	18.11.2025	105 %
	6	02.02.2026	17.02.2026	105 %
	7	04.05.2026	19.05.2026	105 %
	8	27.07.2026	03.08.2026	105 %
Условие выплаты Дополнительного дохода	Барьер дополнительного дохода считается достигнутым, если в Дату оценки значение Показателя базового актива выше Барьера дополнительного дохода или равно Барьеру дополнительного дохода.			
Барьер дополнительного дохода	Применим. Определяется как процент от Первоначального значения Базового актива.			

<p>Порядок определения размера Дополнительного дохода</p>	<p>Сумма Дополнительного дохода на одну Облигацию рассчитывается по следующей формуле:</p> $ДД = \text{Ном} \times P \times (m + 1), \text{ где:}$ <p><i>ДД</i> – сумма Дополнительного дохода на одну Облигацию, округлённая до 2 знаков после запятой, в рублях;</p> <p><i>Ном</i> – номинал одной Облигации, в долларах США;</p> <p><i>m</i>:</p> <p>(1) если до Даты оценки_n было не менее одной Даты оценки, на которую Условие выплаты Дополнительного дохода не выполнялось, то <i>m</i> является количеством соответствующих Дат оценок, на которые Условие выплаты Дополнительного дохода не выполнялось, и наступивших после наиболее поздней Даты оценки, на которую Условие выплаты Дополнительного дохода было выполнено;</p> <p>(2) если до Даты оценки_n не было ни одной Даты оценки, на которую Условие выплаты Дополнительного дохода было выполнено, то $m=n-1$, где <i>n</i> – порядковый номер выплаты Дополнительного дохода;</p> <p><i>P</i> – Параметр формулы расчета Дополнительного дохода.</p>
<p>Параметр формулы расчета Дополнительного дохода</p>	<p>7,5 %</p>
<p>Выплата Дополнительного дохода при досрочном погашении по требованию владельцев облигаций</p>	<p>Не выплачивается</p>
<p>Выплата Дополнительного дохода в случае наступления События дестабилизации</p>	<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>
<p>5 УСЛОВИЯ ПОГАШЕНИЯ ОБЛИГАЦИЙ</p>	
<p>Условия досрочного погашения</p>	

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	05.11.2024	20.11.2024	105 %
	2	03.02.2025	18.02.2025	105 %
	3	05.05.2025	20.05.2025	105 %
	4	04.08.2025	19.08.2025	105 %
	5	03.11.2025	18.11.2025	105 %
	6	02.02.2026	17.02.2026	105 %
	7	04.05.2026	19.05.2026	105 %
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	05.11.2024	100 %	
	2	03.02.2025	100 %	
	3	05.05.2025	100 %	
	4	04.08.2025	100 %	
	5	03.11.2025	100 %	
	6	02.02.2026	100 %	
	7	04.05.2026	100 %	
Условия погашения в Плановую дату погашения				
Обстоятельства, от наступления или ненаступления которых зависит осуществление выплат по Облигациям	Наступление Барьера погашения	События дестабилизации		
	Применимо	Применимо		
Предельная дата оценки	27.07.2026			
Барьер погашения	100 % от Первоначального значения Базового актива. Барьер погашения считается достигнутым, если в Предельную дату оценки значение Показателя базового актива ниже Барьера погашения или равно Барьеру погашения			
Порядок определения выплат при погашении Облигаций	Сумма выплаты на одну Облигации при погашении в случае достижения Барьера погашения рассчитывается по следующей формуле: $Redemption = Nom * \frac{P_{final}}{P_{initial}}$ где: Redemption – цена погашения одной Облигации, в рублях;			

	<p>Nom – номинал одной Облигации, в рублях; P_{final} – Значение Базового актива в Предельную дату оценки; P_{initial} – Первоначальное значение Базового актива.</p> <p>Сумма выплаты на одну Облигацию при погашении, если Барьер погашения не достигнут, равна 100% номинальной стоимости Облигации.</p> <p>Сумма выплаты на одну Облигацию при погашении, если Событие дестабилизации наступает, определяется в соответствии с Решением о выпуске Облигаций.</p>
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 «Инвестиционная компания «ФИНАМ»</p> <p>сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО «ФИНАМ»</p> <p>для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739572343</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: 253400RX97D57C13PT68 (LEI)</p> <p>ИНН (при наличии): 7731038186</p> <p>место нахождения и адрес: Российская Федерация, г. Москва, 127006, город Москва, вн.тер.г. Муниципальный округ Тверской, Настасьинский переулок, дом 7, строение 2, ком.33.</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