

## ПРИКАЗ № 1

*об определении ключевых условий выпуска по структурным облигациям  
Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное  
финансовое общество Румберг Структурные Продукты» серии СП-1-5*

г. Москва

03.09.2024

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-1-5, регистрационный номер 6-05-00761-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-1-5 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.

<b>1 ПАРАМЕТРЫ ОБЛИГАЦИЙ</b>	
<b>ISIN</b>	RU000A108FA6
<b>Валюта номинальной стоимости Облигаций</b>	Рубли РФ
<b>Валюта, в которой осуществляются расчеты при размещении Облигаций</b>	Рубли РФ
<b>Валюта, в которой осуществляются выплаты по Облигациям</b>	Рубли РФ
<b>Номинальная стоимость одной Облигации</b>	1 000 рублей РФ
<b>Цена размещения Облигации</b>	1 000 (одна тысяча) рублей 00 копеек за Облигацию (100 % от номинальной стоимости Облигации)
<b>Период размещения Облигаций</b>	25.09.2024
<b>Плановая дата погашения Облигаций</b>	30.09.2026
<b>Инвестор(ы)</b>	Определяются как физические и юридические лица, являющиеся квалифицированными инвесторами, имеющие право приобретать Облигации в соответствии с законодательством Российской Федерации.
<b>Порядок размещения</b>	Размещение на организованных торгах, проводимых ПАО Московская Биржа, ОГРН: 1027739387411

## 2 БАЗОВЫЙ АКТИВ

Базовый актив	Наименование (описание) Индекса	ISIN	Страница Индекса	Администратор индекса	Дата оценки Первоначального значения	Биржа срочных контрактов
	Румберг Технологический Сектор_ПДН_Д	RU000A108Y37	<a href="https://index.rumberg.ru/rtechtrd">https://index.rumberg.ru/rtechtrd</a>	Акционерное общество «Румберг Технолоджис», ОГРН: 1237700069420	26.09.2024	Не применимо
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.					
Стоимость Облигации (в % от номинальной стоимости), при недостижении которой Событие дестабилизации считается наступившим при наступлении Основания дестабилизации	1 000 % от номинальной стоимости Облигации.					

<b>3 КУПОННЫЙ ДОХОД ПО ОБЛИГАЦИЯМ</b>				
<b>Размер процентной ставки купонного дохода</b>	0,00000001 % годовых 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			
<b>4 ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЙ ДОХОД ПО ОБЛИГАЦИЯМ</b>				
<b>Даты оценки и Даты выплаты Дополнительного дохода</b>	<b>№</b>	<b>Дата оценки</b>	<b>Дата выплаты</b>	<b>Барьер дополнительного дохода</b>
	1	26.03.2025	10.04.2025	100 %
	2	24.09.2025	09.10.2025	100 %
	3	25.03.2026	09.04.2026	100 %
	4	23.09.2026	30.09.2026	100 %
<b>Условие выплаты Дополнительного дохода</b>	Барьер дополнительного дохода в соответствующую Дату оценки считается достигнутым, если в Дату оценки значение Показателя базового актива выше Барьера дополнительного дохода или равно Барьеру дополнительного дохода.			
<b>Барьер дополнительного дохода</b>	Применим.			

<p><b>Порядок определения размера Дополнительного дохода</b></p>	<p>Сумма Дополнительного дохода на одну Облигацию рассчитывается по следующей формуле:</p> $ДД = Nom \times P \times (m + 1), \text{ где:}$ <p>ДД – сумма Дополнительного дохода на одну Облигацию, округлённая до 2 знаков после запятой, в Валюте номинальной стоимости Облигаций;</p> <p><b>Nom</b> – номинал одной Облигации;</p> <p><b>m:</b></p> <p>(1) если до Даты оценки<sub>n</sub> 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<sub>n</sub> не было ни одной Даты оценки, на которую Условие выплаты Дополнительного дохода было выполнено, то <i>m</i>=<i>n</i>-1, где <i>n</i> – порядковый номер выплаты Дополнительного дохода;</p> <p><b>P</b> – Параметр формулы расчета Дополнительного дохода.</p>
<p><b>Параметр формулы расчета Дополнительного дохода</b></p>	<p>14%</p>
<p><b>Выплата Дополнительного дохода при досрочном погашении по требованию владельцев облигаций</b></p>	<p>Не выплачивается</p>
<p><b>Выплата Дополнительного дохода в случае наступления События дестабилизации</b></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>

5 УСЛОВИЯ ПОГАШЕНИЯ ОБЛИГАЦИЙ				
<b>Условия досрочного погашения</b>				
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	26.03.2025	10.04.2025	105%
	2	24.09.2025	09.10.2025	105%
	3	25.03.2026	09.04.2026	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	26.03.2025	100 %	
	2	24.09.2025	100 %	
	3	25.03.2026	100 %	
<b>Условия погашения в Плановую дату погашения</b>				
Обстоятельства, от наступления или ненаступления которых зависит осуществление выплат по Облигациям	Наступление Барьера погашения		События дестабилизации	
	Применимо		Применимо	
Предельная дата оценки	23.09.2026			
Барьер погашения	100 %. 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: $\text{Redemption} = \text{Nom} \times \frac{P_{\text{final}}}{P_{\text{initial}}}$ , где:			

	<p><b>Redemption</b> – цена погашения одной Облигации, в Валюте номинальной стоимости Облигаций;</p> <p><b>Nom</b> – Номинальная стоимость одной Облигации;</p> <p><b>P<sub>final</sub></b> – Значение Базового актива в Предельную дату оценки;</p> <p><b>P<sub>initial</sub></b> – 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>
<b>6 ИНЫЕ СВЕДЕНИЯ ПО ОБЛИГАЦИЯМ</b>	
<b>Дата приобретения Облигаций по соглашению с владельцами</b>	Отсутствует
<b>Цена приобретения Облигаций по соглашению с владельцами</b>	Не применимо
<b>Сумма, выплачиваемая владельцам Облигаций при досрочном погашении по требованию их владельцев</b>	Аналогично Событию дестабилизации
<b>Возможность частичного досрочного погашения Облигаций по усмотрению Эмитента</b>	Не предусмотрена
<b>Расчётный агент</b>	<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><b>Дилеры-ориентиры</b></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><b>Депозитарий / лицо, осуществляющее выплаты по Облигациям</b></p>	<p>НКО АО НРД</p>
<p><b>Вторичное обращение</b></p>	<p>Обращение на организованных торгах, проводимых ПАО Московская Биржа, ОГРН: 1027739387411</p>
<p><b>Применимость положений секции 871 (m) Налогового кодекса США к доходу по Облигациям</b></p>	<p>Не применимы. Основание:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> Все Базовые активы (один или несколько) не является/не являются американским(и)</li> <li><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</li> <li><input type="checkbox"/> Все или некоторые Базовые активы (один или несколько) является/являются американским(и) индексом(ами) акций широкого рынка</li> <li><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</li> </ul>