

ПРИКАЗ № 1

об изменении ключевых условий выпуска по структурным облигациям Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество Румберг Структурные Продукты» серии СП-1-13

г. Москва

07.11.2024

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-1-13, регистрационный номер 6-08-00761-R-001P от 02.09.2024,

ПРИКАЗЫВАЮ

Внести изменения в приказ № 1 от 03.09.2024 и в приказ № 1 от 29.10.2024 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-1-13 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 | RU000A109EJ8 |
| 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) |
| Дата размещения Облигаций | 29.11.2024 |
| Плановая дата погашения Облигаций | 04.12.2026 |
| 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 | Страница Индекса | Администратор индекса | Дата оценки Первоначального значения | Биржа срочных контрактов |
| | Румберг Широкий Рынок_Д | RU000A109E30 | https://index.rumberg.ru/rwmd | Акционерное общество «Румберг Технолоджис», ОГРН: 1237700069420 | 02.12.2024 | 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. | | | | | |

| 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 | № | Дата оценки | Дата выплаты | Барьер дополнительного дохода |
| | 1 | 27.11.2026 | 04.12.2026 | 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> $ДД = Nom \times \frac{\text{Max}\left[\frac{P_{\text{фин}}}{P_{\text{нач}}} \times 100\% - K; 0\right]^1}{100\%}, \text{ где:}$ <p>ДД – сумма Дополнительного дохода на одну Облигацию, округлённая до 2 знаков после запятой, в валюте номинальной стоимости Облигаций;</p> <p>Nom – Номинальная стоимость одной Облигации;</p> <p>K – страйк;</p> <p>P_{фин} – Значение Базового актива в Предельную дату оценки;</p> <p>P_{нач} – Первоначальное значение Базового актива.</p> | | | |
| Страйк | 100% | | | |
| 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 | 03.12.2024 | 18.12.2024 | 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 | 03.12.2024 | 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 | 27.11.2026 | | | |
| 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 «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, г. Москва, вн.тер.г. Муниципальный Округ Тверской, пер Настасьинский, д. 7, стр. 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 |