

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

СООБЩЕНИЕ О КЛЮЧЕВЫХ УСЛОВИЯХ ВЫПУСКА СТРУКТУРНЫХ ОБЛИГАЦИЙ АО «СБЕРБАНК КИБ»

Дата приказа Президента АО «Сбербанк КИБ» об утверждении настоящего Сообщения о ключевых условиях выпуска структурных облигаций АО «Сбербанк КИБ» (далее – «Сообщение»): **7 марта 2025 г.**

Вид, категория (тип), серия, номер и дата государственной регистрации выпуска ценных бумаг и иные идентификационные признаки размещаемых ценных бумаг: облигации структурные бездокументарные неконвертируемые с залоговым обеспечением процентные, регистрационный номер выпуска **6-964-01793-А от 25.11.2024 г. (далее – «Облигации»)**.

Серия: **СІВ-СО-964**

ISIN: **RU000A10A5Y2**

Количество Облигаций: **2 000 000 (Два миллиона) штук**

Валюта номинальной стоимости Облигаций: **рубли РФ**

Номинальная стоимость одной Облигации: **1 000 (Одна тысяча) рублей РФ**

Общая номинальная стоимость Облигаций: **2 000 000 000 (Два миллиарда) рублей РФ**

Примечания:

1. Если в настоящем Сообщении не указано иное, термины, употребляемые в нем с заглавной буквы, имеют значение, указанное в Решении о выпуске;
2. Любые термины, использованные в единственном числе, также включают в себя указание их во множественном числе, если иное прямо не указано в содержании настоящего сообщения.

3. Поля, отмеченные знаком «*» используются в настоящем сообщении в случае, если они применимы в отношении Эмитента/Облигаций на дату составления настоящего сообщения.

Настоящий документ был подготовлен АО «Сбербанк КИБ» (далее – «Эмитент») и раскрыт на Странице в сети Интернет исключительно для информирования потенциальных покупателей – квалифицированных инвесторов Облигаций о сведениях о ключевых условиях выпуска структурных облигаций Эмитента (далее – «СО», «Облигации») и не может быть воспроизведен, передан или распространен далее представителям СМИ или любому иному лицу либо опубликован полностью или частично для каких-либо целей.

Содержание настоящего Сообщения о ключевых условиях выпуска не является рекламой СО Эмитента или предложением, обязательством, рекомендацией, индивидуальной инвестиционной рекомендацией, побуждением совершать операции на финансовом рынке. Несмотря на получение информации из Сообщения о ключевых условиях выпуска, Вы самостоятельно принимаете все инвестиционные решения и обеспечиваете соответствие таких решений Вашему инвестиционному профилю в целом и в частности Вашим личным представлениям об ожидаемой доходности от операций с СО, о периоде времени, за который определяется такая доходность, а также о допустимом для Вас риске убытков от таких операций, принимая во внимание, что структурные облигации в соответствии с законодательством Российской Федерации являются долговыми ценными бумагами без защиты капитала, неся в себе таким образом риск полного или частичного невозврата инвесторам номинальной стоимости этих инструментов и/или структурного дохода по ним. Эмитент не гарантирует доходов от указанных в данном Сообщении о ключевых условиях выпуска СО и не несет ответственности за результаты Ваших инвестиционных решений, принятых на основании предоставленной Эмитентом информации.

Любое приобретение СО должно осуществляться исключительно на основании сведений, содержащихся в эмиссионной документации СО.

Сообщение о ключевых условиях выпуска является документом, предназначенным для информирования потенциальных покупателей Облигаций – квалифицированных инвесторов об условиях выпуска СО и решениях, принятых Эмитентом в отношении выпуска СО.

Возврат инвесторам номинальной стоимости СО и/или выплата структурного дохода по СО зависит от наступления или не наступления обстоятельств, указанных в эмиссионной документации СО, такие обстоятельства в частности могут включать в себя наступление определенных событий (банкротство, неплатеж и т.д.) (далее – «Кредитное событие») в связи с неисполнением конкретным лицом определенных платежных обязательств (далее – «Контрольное обязательство»), а также могут включать в себя наступление определенных событий (далее – «Барьерное событие») в связи с неблагоприятным изменением значений Базового актива, являющегося валютной парой. Таким образом риск инвестора проявляется в неблагоприятном изменении значения Базового актива, являющегося валютной парой, повышении вероятности наступления Кредитного события, неблагоприятном изменении цены (стоимости) СО - в том числе из-за неблагоприятного изменения политической ситуации, резкой девальвации национальной валюты, кризиса рынка государственных долговых обязательств, банковского и валютного кризиса, обстоятельств непреодолимой силы, главным образом стихийного и военного характера, и как следствие, приводит к снижению доходности или даже убыткам. Стоимость СО может как расти, так и снижаться, и ее рост в прошлом не означает ее роста в будущем.

Приобретение СО не означает приобретение владельцем СО прав требования по Контрольному обязательству. В результате приобретения СО к владельцу СО не переходят права требования в отношении Контрольного обязательства.

Доход по СО и экономическая выгода от приобретения СО может не совпадать с доходом от владения правами требования по Контрольному обязательству.

| 1. ОБЩИЕ СВЕДЕНИЯ ОБ ЭМИТЕНТЕ | | |
|--|---|--|
| 1.1. | Полное фирменное наименование Эмитента | Акционерное общество «Сбербанк КИБ» (далее и ранее – «Эмитент») |
| 1.2. | Сокращенное фирменное наименование Эмитента | АО «Сбербанк КИБ» |
| 1.3. | Место нахождения Эмитента | Российская Федерация, город Москва |
| 1.4. | Почтовый адрес | 117312, город Москва, улица Вавилова, дом 19 |
| 1.5. | ОГРН Эмитента | 1027739007768 |
| 1.6. | ИНН Эмитента | 7710048970 |
| 2. ОБЩИЕ УСЛОВИЯ РАЗМЕЩЕНИЯ ОБЛИГАЦИЙ | | |
| БИРЖЕВОЕ РАЗМЕЩЕНИЕ | | |
| 2.1. | Порядок размещения Облигаций | Сведения, касающиеся условий размещения Облигаций, приводятся в Условиях размещения, который публикуется Эмитентом на Странице в сети Интернет не позднее Даты начала размещения Облигаций |
| 2.2. | Цена размещения Облигаций | 100.00% от Номинальной стоимости одной Облигации, 1 000.00 рублей РФ. |
| 2.3. | Инвесторы | Физические и юридические лица, являющиеся квалифицированными инвесторами, имеющие право приобретать Облигации в соответствии с законодательством РФ |
| 2.4. | Потенциальные приобретатели (покупатели) Облигаций | 1. Квалифицированные инвесторы, указанные в п. 2 ст. 51.2 Федерального закона от 22.04.1996 № 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг», представляющие собственные интересы; 2. Брокеры, представляющие интересы Инвесторов |
| 2.5. | Специальный счет Эмитента для поступления денежных средств от размещения Облигаций | Сведения, касающиеся условий размещения Облигаций, приводятся в Условиях размещения, который публикуется Эмитентом на Странице в сети Интернет не позднее Даты начала размещения Облигаций |
| 3. УСЛОВИЯ О БАЗОВЫХ АКТИВАХ | | |
| 3.1. | Базовые активы | Контрольное обязательство и Базовый актив, являющийся валютной парой |
| 3.2. | Контрольное обязательство | Финансовое обязательство Контрольного лица, соответствующее указанным ниже Признакам обязательств |

| | | | | |
|---------------|--------------------------|--|--|---|
| 3.3. | Кредитные события | Кредитным событием считается наступление любого обстоятельства, из числа соответствующих типу такого Контрольного лица Кредитных событий, в отношении Контрольного обязательства Контрольного лица с признаками, соответствующими Признакам обязательств. | | |
| | Контрольное лицо | Уникальный код Контрольного лица (эмитента) | Кредитные события | Признаки обязательств, Применяемая Матрица |
| ПАО "НОВАТЭК" | 00268-E | <ol style="list-style-type: none"> 1. Банкротство (Bankruptcy) 2. Государственное вмешательство (Governmental Intervention) 3. Неплатеж (Failure to Pay) 4. Требование досрочного исполнения обязательства (Obligation Acceleration) 5. Отказ от исполнения обязательства/Мораторий (Repudiation/Moratorium) 6. Реструктуризация обязательства (Restructuring) | Признаки обязательства «Облигации», указанные в разделе «Стандартное контрольное обязательство» Матрицы, соответствующее следующему признаку: Обязательство Контрольного лица возникает в соответствии с российским законодательством или регулируется им. Российская матрица, разработанная в соответствии с регламентом РОК и опубликованная РОК на странице в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» для публикации материалов и информации о деятельности РОК - http://rok-rf.ru/ ¹ . | Применимые Условия кредитных производных сделок НАУФОР |

¹ На дату утверждения настоящего Сообщения такой страницей является https://new.nfa.ru/upload/iblock/49f/Matritsa-obektov-rassmotreniya-ROK_utv.-19.04.22.pdf

| | | |
|------|---|--|
| 3.4. | Базовый актив, являющийся валютной парой | Валютная пара Швейцарский франк/рубль РФ |
| 3.5. | Порядок определения значения Базового актива, являющегося валютной парой | <p>Значение Базового актива, являющегося валютной парой, установленное и опубликованное на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (www.cbr.ru), в соответствующую Дату оценки и используемое для расчётов, начиная со следующего после соответствующей Даты оценки дня.</p> <p>В случае, если значение Базового актива, являющегося валютной парой, будет отсутствовать (не будет опубликовано на официальном сайте Банка России) на соответствующую Дату оценки, при условии, что Расчетным агентом не будет установлено наступление События нарушения, значение Базового актива, являющегося валютной парой, будет определено Расчетным агентом на основании котировок на соответствующую Дату оценки, полученных Расчетным агентом у не менее чем четырех банков, выбранных Расчетным агентом из числа ведущих на рынке соответствующих валют, в следующем порядке:</p> <p>(А) если предоставлено не менее четырех котировок, - как среднее арифметическое котировок, 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>(Б) если предоставлены две или три котировки, - как среднее арифметическое предоставленных котировок.</p> <p>В случае, если значение Базового актива, являющегося валютной парой, не может быть определено Расчетным агентом на соответствующую Дату оценки, в установленном выше порядке, значение Базового актива, являющегося валютной парой, будет определено Расчетным агентом в соответствии с разумными коммерческими принципами.</p> <p>Значение Базового актива, являющегося валютной парой, округляется до четырёх знаков после запятой.</p> |
| 3.6. | Начальное значение Базового актива, являющегося валютной парой | Значение Базового актива, являющегося валютной парой, в Дату определения Начального значения Базового актива, являющегося валютной парой |
| 3.7. | Финальное значение Базового актива, являющегося валютной парой | Значение Базового актива, являющегося валютной парой, в Дату определения Финального значения Базового актива, являющегося валютной парой |
| 3.8. | Дата определения Начального значения Базового актива, являющегося валютной парой | 12 марта 2025 г. |

| | | |
|-------|---|--|
| 3.9. | Дата определения Финального значения Базового актива, являющегося валютной парой | 2-й Рабочий день курса до Даты погашения Облигаций |
| 3.10. | Даты оценки | Совместно: - Дата определения Начального значения Базового актива, являющегося валютной парой, - Дата определения Финального значения Базового актива, являющегося валютной парой, - Промежуточная Дата оценки, - Дата определения значения Базового актива, являющегося валютной парой, для целей определения выплат при досрочном погашении Облигаций в связи с наступлением Кредитного события, - Дата определения значения Базового актива, являющегося валютной парой, для целей определения выплат при досрочном погашении Облигаций по требованию их владельцев |
| 3.11. | Промежуточная Дата оценки | Дата, указанная в колонке «Промежуточная дата оценки» в разделе «Периоды структурного дохода». |
| 3.12. | Сведения о порядке раскрытия Расчетным агентом информации, предусмотренной Решением о выпуске | Расчетный агент публикует информацию на странице в сети интернет www.sberbank.ru (или иной странице-правопреемнике) в течение следующего Рабочего дня, когда указанная информация стала общедоступной либо когда указанная информация стала известна Расчетному агенту (в зависимости от того, какая из дат является более ранней) |
| 3.13. | Вариант зависимости выплат по Облигациям, в том числе наступления (ненаступления) обязательства Эмитента осуществить досрочное погашение Облигаций, от параметров и значений Базовых активов | Вариант (А): В целях определения: (1) основания досрочного погашения по усмотрению Эмитента – используются параметры Контрольного обязательства и Базового актива, являющегося валютной парой, (2) суммы выплат по Облигациям при досрочном погашении – используются параметры Контрольного обязательства и Базового актива, являющегося валютной парой, (3) Барьерного события для целей определения выплат по Облигациям при погашении – используются параметры Базового актива, являющегося валютной парой, (4) суммы выплат при погашении Облигаций – используются параметры Базового актива, являющегося валютной парой. |

4. УСЛОВИЯ О СТРУКТУРНОМ ДОХОДЕ

| | | | | | |
|------|-----------------------------------|--|---|----------------------------------|---|
| 4.1. | Период структурного дохода | | | | |
| | | Дата начала Периода структурного дохода | Дата окончания Периода структурного дохода | Промежуточная Дата оценки | Дата проверки Кредитного события для |

| | | | | | целей выплаты структурного дохода |
|------|---|--|------------------|--|---|
| | | 12 марта 2025 г. | 12 марта 2026 г. | 2-й Рабочий день курса до Даты окончания Периода структурного дохода | 5-ый Рабочий день до Даты окончания Периода структурного дохода |
| 4.2. | Периодичность выплаты структурного дохода | <p>В Дату окончания Периода структурного дохода, если выполнено Условие выплаты структурного дохода.</p> <p>Если Дата окончания Периода структурного дохода приходится на день, не являющийся Рабочим днём, сумма структурного дохода выплачивается в первый Рабочий день после Даты окончания Периода структурного дохода.</p> | | | |
| 4.3. | Условие выплаты структурного дохода | <p>Структурный доход выплачивается (Условие выплаты структурного дохода считается выполненным), если за период с Даты начала размещения Облигаций до Даты проверки Кредитного события для целей выплаты структурного дохода (включительно) в отношении Контрольного лица одновременно:</p> <p>a) Не наступило (отсутствует) ни одно Кредитное событие в отношении Контрольного обязательства;</p> <p>b) У Расчетного агента отсутствуют разумные и коммерчески обоснованные сомнения в возможности определения Преемник(а/ов) в отношении Контрольного лица (далее – «Сомнения в возможности определения Преемник(а/ов)»);</p> <p>c) Расчетный агент не принял решение о невозможности определения Преемник(а/ов) в отношении Контрольного лица;</p> <p>d) Не наступило (отсутствует) Событие нарушения</p> <p>Во избежание сомнений, если до Даты проверки Кредитного события для целей выплаты структурного дохода (включительно) у Расчетного агента есть Сомнения в возможности определения Преемник(а/ов), структурный доход не выплачивается.</p> | | | |
| 4.4. | Размер (порядок определения размера) структурного дохода | <p>Структурный доход на одну Облигацию за Период структурного дохода определяется по формуле:</p> <p>При выполнении Условия выплаты структурного дохода:</p> $ДД = Н \times P \times CHFRUB_{пл} / CHFRUB_{нач}, \text{ где}$ <p>ДД – сумма структурного дохода на одну Облигацию в Валюте номинальной стоимости Облигации;</p> <p>Н – Номинальная стоимость одной Облигации в Валюте номинальной стоимости Облигации;</p> | | | |

| | | |
|---------------------------------------|--|--|
| | | <p>CHFRUB_{пл} – Значение Базового актива, являющегося валютной парой, в Промежуточную Дату оценки</p> <p>CHFRUB_{нач} - Начальное значение Базового актива, являющегося валютной парой</p> <p>P – Параметр формулы расчета структурного дохода;</p> <p>Размер структурного дохода, подлежащего выплате на одну Облигацию, округляется до второго знака после запятой.</p> <p>При невыполнении Условия выплаты структурного дохода:</p> <p>Размер структурного дохода устанавливается равным нулю.</p> |
| 4.5. | Значение Параметра формулы расчета структурного дохода | <p>Не менее 7.600%</p> <p>Если иное значение не будет установлено Эмитентом и опубликовано на Странице в сети Интернет до Даты начала размещения Облигаций, значение Параметра формулы расчета структурного дохода считается равным 7.600%</p> |
| 4.6. | Выплата структурного дохода при досрочном погашении Облигаций | <p>Определена в разделах «Условия погашения Облигаций» и «Иные условия» настоящего Сообщения о ключевых условиях выпуска</p> |
| 5. УСЛОВИЯ ПОГАШЕНИЯ ОБЛИГАЦИЙ | | |
| 5.1. | Дата погашения Облигаций | 12 марта 2027 г. |
| 5.2. | Дата проверки Кредитного события до Даты погашения Облигаций | 26 февраля 2027 г. |
| 5.3. | Барьерное событие для целей определения выплат по Облигациям при погашении | <p>Барьерное событие для целей определения выплат по Облигациям при погашении считается наступившим, если значение Базового актива, являющегося валютной парой, в Дату проверки Барьерного события для целей определения выплат по Облигациям при погашении, меньше Начального значения Базового актива, являющегося валютной парой.</p> |
| 5.4. | Дата проверки Барьерного события для целей определения выплат по Облигациям при погашении | Дата определения Финального значения Базового актива, являющегося валютной парой |

| | | |
|------|--|---|
| 5.5. | <p>Размер выплат при погашении Облигаций в Дату погашения Облигаций</p> | <p>Выплаты по Облигациям при их погашении, порядок определения размера которых указан в настоящем разделе, осуществляются при условии, что Облигации не были досрочно погашены и при ненаступлении оснований для досрочного погашения Облигаций.</p> <p>(А) при наступлении Барьерного события и при условии ненаступления События нарушения – Облигации погашаются по цене меньше номинальной стоимости Облигаций, определённой как результат следующей формулы:</p> $R = H \times CHF RUB_{фин} / CHF RUB_{нач}, \text{ где}$ <p>R – сумма погашения в Валюте номинальной стоимости Облигаций H – Номинальная стоимость 1 (одной) Облигации в Валюте номинальной стоимости Облигаций CHF RUB_{фин} – Финальное значение Базового актива, являющегося валютной парой CHF RUB_{нач} – Начальное значение Базового актива, являющегося валютной парой</p> <p>(Б) При наступлении Событий нарушения для целей определения суммы погашения и при условии ненаступления Барьерного события - размер выплат при погашении Облигаций, который может быть меньше номинальной стоимости Облигаций, определяется Расчетным агентом, действующим в соответствии с разумными коммерческими принципами.</p> <p>(В) При наступлении Барьерного события и при условии наступления События нарушения для целей определения суммы погашения - размер выплат при погашении Облигаций, который может быть меньше номинальной стоимости Облигаций, определяется Расчетным агентом, действующим в соответствии с разумными коммерческими принципами в соответствии с положениями Решения о выпуске.</p> <p>Г) при ненаступлении Барьерного события и при условии ненаступления События нарушения для целей определения суммы погашения – Облигации погашаются по цене не менее номинальной стоимости Облигаций, определённой как результат следующей формулы:</p> $R = H \times CHF RUB_{фин} / CHF RUB_{нач}, \text{ где}$ <p>R – сумма погашения в Валюте номинальной стоимости Облигаций H – Номинальная стоимость 1 (одной) Облигации в Валюте номинальной стоимости Облигаций CHF RUB_{фин} – Финальное значение Базового актива, являющегося валютной парой</p> |
|------|--|---|

| | | <p>CHF RUB_{нач} – Начальное значение Базового актива, являющегося валютной парой</p> <p>Сумма выплаты в рублях РФ, выплачиваемая при погашении на одну Облигацию, округляется до 2 знаков после запятой в соответствии с математическими правилами округления.</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|---|-------------------|--|---|--|-----------|-----------|--------------|-----------|-----------|-----------------|-----------|-----------|--------------------------------------|-----------|-----------|--------------------|--------------|--------------|---------------|------------------|------------------|---|------------------|------------------|-------------------------|------------------|------------------|---------------------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|------------------|---|--|
| 5.6. | Применимость Событий нарушения | В порядке, указанном ниже | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5.7. | События нарушения | <table border="1"> <thead> <tr> <th>Событие нарушения</th> <th>Применимость для целей досрочного погашения</th> <th>Применимость для целей определения суммы погашения</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Изменение законодательства</td> <td>применимо</td> <td>применимо</td> </tr> <tr> <td>Незаконность</td> <td>применимо</td> <td>применимо</td> </tr> <tr> <td>Нарушение хеджа</td> <td>применимо</td> <td>применимо</td> </tr> <tr> <td>Существенное изменение обстоятельств</td> <td>применимо</td> <td>применимо</td> </tr> <tr> <td>Биржевое нарушение</td> <td>не применимо</td> <td>не применимо</td> </tr> <tr> <td>Неликвидность</td> <td><u>применимо</u></td> <td><u>применимо</u></td> </tr> <tr> <td>Общая неконвертируемость и непередаваемость</td> <td><u>применимо</u></td> <td><u>применимо</u></td> </tr> <tr> <td>Нарушение источника цен</td> <td><u>применимо</u></td> <td><u>применимо</u></td> </tr> <tr> <td>Множественность валютных курсов</td> <td><u>применимо</u></td> <td><u>применимо</u></td> </tr> <tr> <td>Слияние валюты</td> <td><u>применимо</u></td> <td><u>применимо</u></td> </tr> </tbody> </table> | Событие нарушения | Применимость для целей досрочного погашения | Применимость для целей определения суммы погашения | Изменение законодательства | применимо | применимо | Незаконность | применимо | применимо | Нарушение хеджа | применимо | применимо | Существенное изменение обстоятельств | применимо | применимо | Биржевое нарушение | не применимо | не применимо | Неликвидность | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | Общая неконвертируемость и непередаваемость | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | Нарушение источника цен | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | Множественность валютных курсов | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | Слияние валюты | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | <p>Наступление События нарушения определяется Расчетным агентом в порядке, предусмотренном Решением о выпуске.</p> <p>Во избежание сомнений, под наступлением События нарушения в настоящем Сообщении о ключевых условиях выпуска понимается наступление одного или нескольких указанных событий.</p> | |
| Событие нарушения | Применимость для целей досрочного погашения | Применимость для целей определения суммы погашения | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Изменение законодательства | применимо | применимо | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Незаконность | применимо | применимо | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Нарушение хеджа | применимо | применимо | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Существенное изменение обстоятельств | применимо | применимо | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Биржевое нарушение | не применимо | не применимо | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Неликвидность | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Общая неконвертируемость и непередаваемость | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Нарушение источника цен | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Множественность валютных курсов | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Слияние валюты | <u>применимо</u> | <u>применимо</u> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5.8. | Период наблюдения Событий нарушения для целей досрочного погашения | <table border="1"> <thead> <tr> <th>Период наблюдения</th> <th>Период, в течение которого Расчетный агент может предоставить Эмитенту информацию о факте наступления События нарушения для целей досрочного погашения</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>С Даты начала размещения Облигаций по Дату проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием</td> <td>С Даты начала размещения Облигаций по 300-й день с Даты проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с</td> </tr> </tbody> </table> | Период наблюдения | Период, в течение которого Расчетный агент может предоставить Эмитенту информацию о факте наступления События нарушения для целей досрочного погашения | С Даты начала размещения Облигаций по Дату проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием | С Даты начала размещения Облигаций по 300-й день с Даты проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Период наблюдения | Период, в течение которого Расчетный агент может предоставить Эмитенту информацию о факте наступления События нарушения для целей досрочного погашения | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| С Даты начала размещения Облигаций по Дату проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием | С Даты начала размещения Облигаций по 300-й день с Даты проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | | | |
|--|---|--|---|
| | | Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события (обе даты - включительно) | отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события (обе даты - включительно) |
| 5.9. | Дата досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением События нарушения | 14-й Рабочий день с даты наступления События нарушения, определенной в соответствии с Решением о выпуске (но не позднее Даты погашения Облигаций). | |
| 5.10. | Размер выплат при досрочном погашении Облигаций в Дату досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением События нарушения | Размер выплат при погашении Облигаций определяется Расчетным агентом, действующим в соответствии с разумными коммерческими принципами. Сумма выплаты в рублях РФ, выплачиваемая при досрочном погашении на одну Облигацию, округляется до 2 знаков после запятой в соответствии с математическими правилами округления. | |
| 5.11. | Выплата структурного дохода при досрочном погашении Облигаций в Дату досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением События нарушения | Не осуществляется | |
| 5.12. | Период наблюдения Событий нарушения для целей определения суммы погашения | Период наблюдения | Период, в течение которого Расчетный агент может предоставить Эмитенту информацию о факте наступления События нарушения для целей определения суммы погашения |
| | | С Даты начала размещения Облигаций по Дату проверки Кредитного события до Даты погашения Облигаций (обе даты - включительно) | С 301-ого дня с Даты проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события по Дату определения Финального значения Базового актива, являющегося валютной парой (обе даты – включительно) |
| Наступление События нарушения для целей (а) досрочного погашения или (б) определения сумм погашения, - рассматривается в зависимости от периода, в течение которого Расчетный агент предоставил Эмитенту информацию о наступлении События нарушения. | | | |

| | | |
|-------|--|---|
| 5.13. | Приоритет событий досрочного погашения Облигаций | В случае одновременного наступления Кредитного события и События (Событий) нарушения для целей досрочного погашения, досрочное погашение Облигаций осуществляется в порядке и на условиях досрочного погашения в случае наступления События нарушения. |
| 5.14. | Досрочное погашение Облигаций в связи с наступлением или отсутствием Кредитного события | Применимо |
| 5.15. | Дата досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события | 12 марта 2026 г. |
| 5.16. | Условие досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события | По состоянию на Дату проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события в отношении Контрольных обязательств Контрольного лица одновременно: <ul style="list-style-type: none"> а. Не наступило (отсутствует) ни одно из Кредитных событий б. Расчётным агентом не было сделано (либо – было сделано и впоследствии отозвано) Уведомление Расчетного агента о риске наступления любого из Кредитных событий |
| 5.17. | Дата проверки Кредитного события до Даты досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события | 4 марта 2026 г. |

| | | |
|-------|---|--|
| 5.18. | <p>Размер выплат (порядок определения выплат) при досрочном погашении Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события</p> | <p>При отсутствии Кредитного события и отсутствии риска наступления Кредитного события и при условии ненаступления События нарушения Облигации погашаются по цене, определённой как результат следующей формулы:</p> $R = H \times \text{CHF RUB}_{\text{пл}} / \text{CHF RUB}_{\text{нач}}$ <p>где</p> <p>R – сумма погашения в Валюте номинальной стоимости Облигаций</p> <p>H – Номинальная стоимость 1 (одной) Облигации в Валюте номинальной стоимости Облигаций</p> <p>CHF RUB_{пл} – Значение Базового актива, являющегося валютной парой, в Промежуточную дату оценки</p> <p>CHF RUB_{нач} – Начальное значение Базового актива, являющегося валютной парой.</p> <p>Сумма выплаты в рублях РФ, выплачиваемая при досрочном погашении на одну Облигацию, округляется до 2 знаков после запятой в соответствии с математическими правилами округления.</p> |
| 5.19. | <p>Выплата структурного дохода при досрочном погашении Облигаций в Дату досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события</p> | <p>Осуществляется</p> |
| 5.20. | <p>Досрочное погашение Облигаций в связи с наступлением Кредитного события</p> | <p>Применимо</p> |
| 5.21. | <p>Дата досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением Кредитного события</p> | <p>1. Если наступление Кредитного события определено Определяющим комитетом:</p> <p>а) 10-й Рабочий день после Даты расчетов по итогам проведения Аукциона в отношении Контрольных обязательств Контрольного лица, где Датой расчетов по итогам проведения Аукциона является соответствующая дата, указанная в разделе «Условия проведения расчетов по итогам Аукциона», но не ранее даты, определенной в пункте «Дата досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события», и не позднее Даты погашения Облигаций;</p> <p>б) 25-й Рабочий день с Даты фиксации Кредитного события, но не ранее даты, определенной в пункте «Дата досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и</p> |

| | | |
|--|--|---|
| | | <p>отсутствием риска наступления Кредитного события», и не позднее Даты погашения Облигаций в случае отсутствия Аукциона (либо информации о проведении Аукциона) в отношении Контрольных обязательств Контрольного лица в течение 15 Рабочих дней после наступления Кредитного события.</p> <p>2. Если наступление Кредитного события определено Расчетным агентом:</p> <p>а) самостоятельно, без обращения в Определяющий комитет - дата, определенная Расчетным агентом с учетом п.5.6.2. Решения о выпуске, но не ранее даты, определенной в пункте «Дата досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события», и не позднее Даты погашения Облигаций</p> <p>б) в результате наступления одного из следующих обстоятельств:</p> <p>1) Наступление События отсутствия ответа Определяющего комитета, либо</p> <p>2) Если в отношении Контрольного лица наступила Дата фиксации Кредитного события в случае, если Секретариат Определяющего комитета (DC Secretary - Термин МАСД) делает объявление о решении Определяющего комитета не рассматривать вопросы, поставленные в Запросе о фиксации Кредитного события,</p> <p>и Расчетный агент в порядке, указанном в Сообщении о ключевых условиях выпуска, публикует держателям Облигаций информацию, соответствующую содержанию Уведомления Определяющего комитета о наступлении Кредитного события (Credit Event Notice - Термин МАСД), а также Уведомления об общедоступной информации (Notice of Publicly Available Information - Термин МАСД):</p> <p>- 10-ый Рабочий день (но не ранее даты, определенной в пункте «Дата досрочного погашения Облигаций в связи с отсутствием Кредитного события и отсутствием риска наступления Кредитного события», и не позднее Даты погашения Облигаций) после соответственно:</p> <p>1) Наступления События отсутствия ответа Определяющего комитета либо</p> <p>2) Даты фиксации Кредитного события в случае, если Секретариат Определяющего комитета (DC Secretary - Термин МАСД) делает объявление о решении Определяющего комитета не рассматривать вопросы, поставленные в Запросе о фиксации Кредитного события.</p> |
|--|--|---|

| | | |
|-------|---|--|
| 5.22. | Условия досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением Кредитного события | <p>Облигации погашаются в Дату досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением Кредитного события если не позднее, чем до Даты проверки Кредитного события до Даты погашения Облигаций, в отношении Контрольного лица наступило/наступила:</p> <ul style="list-style-type: none"> • одно или несколько Кредитных событий <p>или</p> <ul style="list-style-type: none"> • Дата фиксации Кредитного события (как она определена в Решении о выпуске) <p>или</p> <ul style="list-style-type: none"> • Событие отсутствия ответа Определяющего комитета, <p>но в любом случае не позднее Даты проверки Кредитного события до Даты погашения Облигаций.</p> <p>Кредитное событие считается наступившим, если его наступление определено Определяющим комитетом и (или) Расчетным агентом, который проинформировал об этом Эмитента и представителя владельцев Облигаций не позднее Даты проверки Кредитного события до Даты погашения Облигаций.</p> <p>Расчетный агент при определении факта наступления Кредитного события может использовать или полагаться на общедоступные данные, касающиеся Контрольных обязательств Контрольного лица.</p> |
| 5.23. | Событие отсутствия ответа Определяющего комитета | <p>Неполучение Расчетным агентом, по истечении 60 (Шестидесяти) календарных дней с момента начала рассмотрения Определяющим комитетом заявки о фиксации Кредитного события, но в любом случае не позднее Даты проверки Кредитного события до Даты погашения Облигаций, Уведомления Определяющего комитета о наступлении Кредитного события или Уведомления Определяющего комитета о ненаступлении Кредитного события</p> |
| 5.24. | Размер выплат (порядок определения выплат) при досрочном погашении Облигаций в связи с наступлением Кредитного события | <p>Облигации погашаются в Дату досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением Кредитного события в сумме, определённой в соответствии с пунктом «Размер выплат по Облигациям при их досрочном погашении в связи с наступлением Кредитного события, определённый с использованием Итоговой цены Контрольных Обязательств Контрольного лица, установленной по результатам Аукциона или Расчетным агентом», за исключением случаев определения выплат при досрочном погашении Облигаций, описанных ниже.</p> |

| | | |
|-------|---|---|
| | | <p>В случае, если Облигации погашаются в Дату досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением Кредитного события в результате наступления одного из обстоятельств, указанных в пп. 1) и 2) настоящего раздела:</p> <p>1) Наступление События отсутствия ответа Определяющего комитета либо</p> <p>2) Если в отношении Контрольного лица наступила Дата фиксации Кредитного события в случае, если Секретариат Определяющего комитета (DC Secretary - Термин МАСД) делает объявление о решении Определяющего комитета не рассматривать вопросы, поставленные в Запросе о фиксации Кредитного события, и Расчетный агент в порядке, указанном в Сообщении о ключевых условиях выпуска, публикует держателям Облигаций информацию, соответствующую содержанию Уведомления о наступлении Кредитного события (Credit Event Notice - Термин МАСД), а также Уведомления об общедоступной информации (Notice of Publicly Available Information - Термин МАСД), -</p> <p>то размер выплат при погашении Облигаций в связи с наступлением Кредитного события определяется Расчетным агентом, действующим в соответствии с разумными коммерческими принципами, используя сложившуюся на момент наступления Кредитного события рыночную практику определения цены долговых обязательств лица с типом, аналогичным типу такого Контрольного лица, после наступления Кредитного события, включая, но не ограничиваясь, положения Условий кредитных производных сделок, с учетом изменения значения Базового актива, являющегося валютной парой.</p> <p>В случае, если наступление Кредитного события в отношении Контрольных обязательств Контрольного лица определяется Расчетным агентом, то размер выплат при погашении Облигаций определяется Расчетным агентом, действующим в соответствии с разумными коммерческими принципами.</p> <p>Сумма выплаты в рублях РФ, выплачиваемая при досрочном погашении на одну Облигацию, округляется до 2 знаков после запятой в соответствии с математическими правилами округления.</p> |
| 5.25. | <p>Выплата структурного дохода при досрочном погашении Облигаций в связи с наступлением Кредитного события</p> | <p>Не осуществляется</p> |
| 5.26. | <p>Условия проведения расчетов по итогам Аукциона</p> | <p>Применительно к тому или иному Кредитному событию – соответствующие условия расчетов, которые будут опубликованы в случае наступления Кредитного события в отношении такого Контрольного лица в соответствии с применимыми Условиями кредитных производных сделок и применимой Матрицей на</p> |

| | | |
|-------|---|--|
| | | <p>странице в сети интернет, используемой для публикации подобных условий Российским определяющим комитетом (РОК) в соответствии с Условиями кредитных производных сделок НАУФОР.</p> <p>Условия кредитных производных сделок НАУФОР доступны в сети Интернет на страницах НАУФОР, Национальной Валютной Ассоциации и Ассоциации российских банков.</p> |
| 5.27. | <p>Размер выплат по Облигациям при их досрочном погашении в связи с наступлением Кредитного события, определённый с использованием Итоговой цены Контрольных обязательств Контрольного лица, установленной по результатам Аукциона или Расчетным агентом</p> | <p>Сумма денежных средств на одну Облигацию, определяемая Расчетным агентом по формуле:</p> $S_{\text{КС}} = \text{MAX}([(H \times P_{\text{final}}) - X/N] \times \text{CHF RUB}_{\text{КС}} / \text{CHF RUB}_{\text{нач}}; 0), \text{ где:}$ <p>S_{КС} – сумма в Валюте номинальной стоимости Облигаций на одну Облигацию, округлённая до 2 знаков после запятой, выплачиваемая при досрочном погашении Облигации в связи с наступлением Кредитного события</p> <p>H – номинал одной Облигации в Валюте номинальной стоимости Облигаций</p> <p>P_{final} – значение Итоговой цены Контрольных обязательств в процентах, опубликованное на странице в сети интернет, используемой Российским определяющим комитетом для публикации информации о значении Окончательной аукционной цены; или, в случаях, указанных в пункте «Размер выплат (порядок определения выплат) при досрочном погашении Облигаций в связи с наступлением Кредитного события», значение Итоговой цены Контрольных обязательств такого Контрольного лица в процентах, определённая Расчетным агентом</p> <p>При этом, если Итоговая цена Контрольных обязательств превышает 100 процентов, то используется значение равное 100 процентам.</p> <p>X – общая сумма экономически обоснованных и подтвержденных Расчетным агентом расходов Эмитента в случае расторжения и/или прекращения Хеджирующих сделок и/или Хеджирующих инструментов в связи с необходимостью досрочного погашения Облигаций по обстоятельствам, не зависящим от усмотрения Эмитента, в рублях РФ</p> <p>N – количество непогашенных Облигаций на Дату досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением Кредитного события</p> <p>CHF RUB_{КС} – Значение Базового актива, являющегося валютной парой, в Дату определения значения Базового актива, являющегося валютной парой, для целей определения выплат при досрочном погашении Облигаций в связи с наступлением Кредитного события</p> <p>CHF RUB_{нач} – Начальное значение Базового актива, являющегося валютной парой</p> <p>MAX (А; Б) – означает выбор большего из значений А и Б согласно математическим правилам</p> |

| | | |
|------------------------|---|--|
| 5.28. | Дата определения значения Базового актива, являющегося валютной парой, для целей определения выплат при досрочном погашении Облигаций в связи с наступлением Кредитного события | 2-й Рабочий день курса, предшествующий Дате досрочного погашения Облигаций в связи с наступлением Кредитного события |
| 6. ИНЫЕ УСЛОВИЯ | | |
| 6.1. | Иные основания для предъявления требований о досрочном погашении Облигаций по требованию их владельцев | Иные, кроме указанных в пункте 5.6.1 Решения о выпуске, основания для предъявления требований о досрочном погашении Облигаций по требованию их владельцев отсутствуют |
| 6.2. | Сумма, выплачиваемая владельцам Облигаций при досрочном погашении по требованию их владельцев | <p>При досрочном погашении Облигации по требованию их владельцев Облигации погашаются по цене, определённой как результат следующей формулы</p> $R = H \times \text{CHF RUB}_{\text{ТВ}} / \text{CHF RUB}_{\text{нач}}$ <p>где</p> <p>R – сумма погашения в Валюте номинальной стоимости Облигаций</p> <p>H – Номинальная стоимость 1 (одной) Облигации в Валюте номинальной стоимости Облигаций</p> <p>CHF RUB_{ТВ} – Значение Базового актива, являющегося валютной парой, в Дату определения значения Базового актива, являющегося валютной парой, для целей определения выплат при досрочном погашении Облигаций по требованию их владельцев.</p> <p>CHF RUB_{нач} – Начальное значение Базового актива, являющегося валютной парой</p> <p>Показатель R может быть уменьшен на стоимость прекращения Хеджирующих сделок в расчёте на одну непогашенную Облигацию (определяется Расчетным агентом).</p> <p>Сумма выплаты в рублях РФ, выплачиваемая на одну Облигацию, округляется до 2 знаков после запятой в соответствии с математическими правилами округления.</p> |

| | | |
|------|---|---|
| | | Датой досрочного погашения Облигаций по требованию их владельцев является 7-ой Рабочий день с даты получения Эмитентом соответствующего требования о досрочном погашении Облигаций, в соответствии с пунктом 5.6.1 Решения о выпуске. |
| 6.3. | Дата определения значения Базового актива, являющегося валютной парой, для целей определения выплат при досрочном погашении Облигаций по требованию их владельцев | 2-й Рабочий день курса, предшествующий Дате досрочного погашения Облигаций по требованию их владельцев. |
| 6.4. | Выплата структурного дохода при досрочном погашении Облигаций по требованию их владельцев | Не выплачивается |
| 6.5. | Возможность частичного досрочного погашения Облигаций по усмотрению Эмитента | Не предусмотрена |
| 6.6. | Расчетный агент | ПАО Сбербанк |
| 6.7. | Рабочие дни | Дни, не являющиеся выходными или праздничными в соответствии с законодательством Российской Федерации |
| 6.8. | Рабочие дни курса | Дни, в которые Банк России устанавливает официальный курс Швейцарского франка к рублю РФ для расчётов на следующий день |
| 6.9. | Сведения о решении Эмитента, в соответствии с которым выплаты в зависимости от наступления или ненаступления обстоятельств, указанных в Решении о выпуске, при погашении Облигаций не осуществляются | При погашении Облигаций выплаты осуществляются в соответствии с разделом 5. Сообщения о ключевых условиях выпуска. Иные обстоятельства, при наступлении которых выплаты при погашении Облигаций не осуществляются, отсутствуют |

| | | |
|-------|---|---|
| 6.10. | Порядок ознакомления с содержанием Решения о выпуске | <p>Текст Решения о выпуске публикуется Эмитентом на Странице в сети Интернет, не позднее Даты начала размещения Облигаций.</p> <p>Потенциальные приобретатели (покупатели) Облигаций и Инвесторы могут также ознакомиться с содержанием Решения о выпуске путём направления запроса по электронной почте на адрес info@sbrf-cib.ru или путём обращения к Эмитенту по адресу: г. Москва, ул. Вавилова, д. 19 в Рабочие дни с 9:00 до 18:00</p> |
|-------|---|---|