

ПРИКАЗ № 1

*об определении ключевых условий выпуска по структурным облигациям
Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное
финансовое общество Румберг Структурные Продукты» серии СП-1-42-ЦБ-
FX-RUB*

г. Москва

«05» августа 2026

В соответствии с решением о выпуске структурных процентных или дисконтных неконвертируемых бездокументарных облигаций Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество Румберг Структурные Продукты» серии СП-1-42-ЦБ-FX-RUB, регистрационный номер 6- 42-00761-R-001P от 02.07.2025 (далее – «**Решение о выпуске**»),

ПРИКАЗЫВАЮ

определить числовые значения (параметры, условия) обстоятельств, от наступления или ненаступления которых зависит осуществление выплат по структурной облигации (или) порядок их определения, размер выплат по структурной облигации или порядок его определения, а также иные условия, установленные Решением о выпуске, 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



Четвериков В.Н.

Решение о ключевых условиях выпуска структурных облигаций процентных или дисконтных неконвертируемых бездокументарных серии СП-1-42-ЦБ-FX-RUB 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 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.

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

1 ПАРАМЕТРЫ ОБЛИГАЦИЙ	
ISIN	RU000A10BZ10
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
Дата начала размещения Облигаций	10.08.2026
Плановая дата погашения Облигаций	23.10.2029
Инвестор(-ы)	Определяются как физические и юридические лица, являющиеся квалифицированными инвесторами, имеющие право приобретать Облигации в соответствии с законодательством Российской Федерации.

2 БАЗОВЫЕ АКТИВЫ

**Базовый актив,
являющийся
Валютным курсом**

Курс российского рубля к одному доллару США, порядок определения которого предусмотрен в разделе «Порядок определения значения Базового актива, являющегося валютным курсом».

Базовые активы, являющиеся ценной бумагой, в составе Корзины	№	Эмитент актива	Категория (тип) ценной бумаги	Тикер	ISIN	CFI	Валюта Базового актива	1.Биржа 2.Источник информации о котировке Базового актива	Вес	Биржа срочных контрактов
	1	Cameco Corp.	Акция	CCJ US	CA13321L1085	ESVTFR	Доллары США	1. New York Stock Exchange (Биржа "NYSE") 2. https://www.nyse.com/quote/XNYS:CCJ (значение "Close/Last")	10%	Все биржи
	2	Ge Vernova Inc.	Акция	GEV US	US36828A1016	ESVUFR	Доллары США	1.New York Stock Exchange (Биржа "NYSE") 2. https://www.nyse.com/quote/XNYS:GEV (значение "Close/Last")	10%	Все биржи
	3	EQT Corp.	Акция	EQT US	US26884L1098	ESVUFR	Доллары США	1.New York Stock Exchange (Биржа "NYSE") 2. https://www.nyse.com/quote/XNYS:EQT (значение "Close/Last")	10%	Все биржи
	4	Constellation Energy	Акция	CEG UQ	US21037T1097	ESVUFR	Доллары США	1.Nasdaq Stock Exchange (Биржа "Nasdaq") 2. https://www.nasdaq.com/market-activity/stocks/ceg/historical (значение "Close/Last")	10%	Все биржи
	5	NextEra Energy Inc.	Акция	NEE US	US65339F1012	ESVUFR	Доллары США	1. New York Stock Exchange (Биржа "NYSE") 2. https://www.nyse.com/quote/XNYS:NEE (значение "Close/Last")	30%	Все биржи

	6	Oklo Inc.	Акция	OKLO US	US02156V1098	ESVUFR	Доллары США	1. New York Stock Exchange (Биржа "NYSE") 2. https://www.nyse.com/quote/XNYS:OKLO (значение "Close/Last")	10%	Все биржи
	7	Eaton Corp Plc.	Акция	ETN US	IE00B8KQN827	ESVUFR	Доллары США	1. New York Stock Exchange (Биржа "NYSE") 2. https://www.nyse.com/quote/XNYS:ETN (значение "Close/Last")	10%	Все биржи
	8	American Electric Power	Акция	AEP UQ	US0255371017	ESVUFR	Доллары США	1. Nasdaq Stock Exchange (Биржа "Nasdaq") 2. https://www.nasdaq.com/market-activity/stocks/aep/historical (значение "Close/Last")	10%	Все биржи
Дата оценки Первоначального значения Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины	16.09.2026									
Дата оценки Финального значения Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины	16.09.2029									
Дата оценки Первоначального значения Базового	08.09.2026									

актива, являющегося Валютным курсом	
Дата оценки Финального значения Базового актива, являющегося Валютным курсом	04.10.2029
Первоначальное значение Базового актива, являющегося Валютным курсом	Значение Базового актива, являющегося Валютным курсом, в Дату оценки Первоначального значения Базового актива, являющегося Валютным курсом, определенное в соответствии с разделом «Порядок определения значения Базового актива, являющегося Валютным курсом» ниже.
Первоначальное значение Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины	Цена каждого Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины в Дату оценки Первоначального значения Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины, определенная в соответствии с разделом «Порядок определения Цены Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины» ниже.
Порядок определения значения Базового актива, являющегося Валютным курсом	Базовый порядок определения: определяется как официальный курс российского рубля к доллару США, опубликованный на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (www.cbr.ru) в Рабочий день непосредственно предшествующий Дате оценки и установленный на соответствующую Дату оценки. Альтернативный порядок определения: если по каким-либо причинам становится невозможно определить значение Базового актива, являющегося Валютным курсом, посредством Базового порядка определения, то значение Базового актива, являющегося Валютным курсом, определяется посредством запроса Расчетным агентом у лица, обладающего лицензией (иным правомочием, проистекающим из личного закона такого лица) на осуществление банковской, дилерской и (или) брокерской деятельности, не являющегося аффилированным лицом Эмитента и (или) Расчетного агента (далее – «Участник финансового рынка»), твердой котировки курса российского рубля к доллару США, выраженного как количество российских рублей за один доллар США. Твердая котировка запрашивается Расчетным агентом, и предоставляется Участником финансового рынка в дату направления соответствующего запроса. Расчетный агент обязан передать Эмитенту информацию о полученной твердой котировке в дату

	определения обменного курса российского рубля к доллару США. Эмитент раскроет значение твердой котировки не позднее Рабочего дня, следующего за датой определения обменного курса российского рубля к доллару США, в Ленте новостей. <i>Примечание:</i> <i>Для целей раздела «Порядок определения значения Базового актива, являющегося Валютным курсом» под твердыми котировками понимаются обязывающие предложения (оферты) Участника финансового рынка купить или продать одну валюту за другую валюту по соответствующему курсу.</i>
Порядок определения Цены Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины	Определяется как абсолютное значение цены (котировки) соответствующего Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины на соответствующей Бирже в соответствующей Валюте Базового актива в Дату оценки, равное официальной цене (котировке) закрытия и определяемое по данным соответствующей Биржи.
Замещающие активы Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины	В качестве Замещающих активов для каждого Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины, могут быть выбраны ценные бумаги, которые существенно отражают ключевые характеристики и риски соответствующего исходного Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины, а также включенные в котировальные списки или допущенные к организованным торгам иным образом на соответствующей Бирже, а в случае, если: i. для соответствующего Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины, в Решении о ключевых условиях предусмотрена(-ы) Альтернативная (-ые) биржа(-ы); и ii. в соответствии с условиями Решения о выпуске соответствующий Базовый актив, являющийся ценной бумагой, в составе Корзины, после исключения из котировальных списков Биржи будет незамедлительно включен в котировальные списки или допущен к торгам иным образом на Альтернативной(-ых) бирже(-ах), то в качестве Замещающих активов для соответствующего Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины могут быть выбраны ценные бумаги, включенные в котировальные списки или допущенные к организованным торгам иным образом на соответствующей Альтернативной(-ых) бирже(-ах).
Показатель базового актива	Определяется как величина в процентах, рассчитываемая по следующей формуле: $\text{Performance} = \left(\sum_{i=1}^n W_i \times \frac{\text{БА}_{\text{eq фин}i}}{\text{БА}_{\text{eq нач}i}} \right) \times \text{БА}_{\text{fx}}$ Где: Performance – Показатель базового актива, в процентах;

	W_i – Вес i-го Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины; $BA_{eq\text{ фин } i}$ – Цена i-го Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины в Дату оценки Финального значения Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины; $BA_{eq\text{ нач } i}$ – Первоначальное значение i-го Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины; n – общее количество Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины; BA_{fx} – значение Базового актива, являющегося Валютным курсом. Несмотря на положения раздела «Порядок определения значения Базового актива, являющегося Валютным курсом», для целей определения Показателя базового актива значение Базового актива, являющегося Валютным курсом, равняется 1.
Дополнительные способы корректировки источников определения Показателя базового актива	Не применимо.
Стоимость Облигации (в % от номинальной стоимости Облигации), при недостижении которой Событие дестабилизации считается наступившим	1 000 % от номинальной стоимости Облигации.

3 КУПОННЫЙ ДОХОД ПО ОБЛИГАЦИЯМ					
Размер процентной ставки купонного дохода		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.			
4 ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЙ ДОХОД ПО ОБЛИГАЦИЯМ					
Дата оценки, Дата выплаты, Барьеры дополнительного дохода	№	Дата оценки	Дата выплаты	Барьер дополнительного дохода	
	1	Дата оценки Финального значения Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины	Плановая дата погашения	100%	
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.				
Порядок определения размера дополнительного дохода	Сумма дополнительного дохода на одну Облигацию рассчитывается по следующей формуле:				
	$ДД = Nom \times P \times \text{MAX} \left[\sum_{i=1}^n w_i \times \frac{BA_{eq \text{ фин } i}}{BA_{eq \text{ нач } i}} - 100\%; 0\% \right] \times \frac{(100\% - FX_{spread}) \times BA_{fx \text{ фин }}}{BA_{fx \text{ нач }}}$ где: ДД – сумма дополнительного дохода на одну Облигацию, округлённая до 2-х знаков после запятой, в Валюте номинальной стоимости Облигаций; BA_{eq фин i} – Цена i-го Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины в Дату оценки Финального значения Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины; BA_{eq нач i} – Первоначальное значение i-го Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины; W_i – Вес i-го Базового актива, являющегося ценной бумагой, в составе Корзины; BA_{fx фин} – Значение Базового актива, являющегося Валютным курсом, в Дату оценки Финального значения Базового актива, являющегося Валютным курсом; BA_{fx нач} – Первоначальное значение Базового актива, являющегося Валютным курсом; Nom – Номинальная стоимость одной Облигации; FX_{spread} – 3%; P – коэффициент участия; n – общее количество Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины;				

	При невыполнении Условия выплаты дополнительного дохода: $ДД = 0$	
Коэффициент участия	100%	
Выплата дополнительного дохода в случае наступления События дестабилизации	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. <u>После наступления События дестабилизации дополнительный доход не выплачивается.</u>	
5 УСЛОВИЯ ПОГАШЕНИЯ ОБЛИГАЦИЙ		
Условия досрочного погашения		
Обстоятельства, от наступления или не наступления которых зависит досрочное погашение Облигаций	Достижение Барьера отзыва	Наступление События дестабилизации
	Не применимо	Применимо
Условия погашения в Плановую дату погашения		
Обстоятельства, от наступления или не наступления которых зависит осуществление выплат по Облигациям	Достижение Барьера погашения	Наступление События дестабилизации
	Применимо	Применимо
Условие достижения Барьера погашения	Барьер погашения считается достигнутым, если в Предельную дату оценки Показатель базового актива ниже Барьера погашения или равен Барьеру погашения.	
Предельная дата оценки	Дата оценки Финального значения Базовых активов, являющихся ценной бумагой, в составе Корзины.	
Барьер погашения	1 %	
Порядок определения размера выплат при погашении Облигаций	Если в Предельную дату оценки Показателем базового актива НЕ ДОСТИГНУТ Барьер погашения, то размер выплаты при погашении по каждой Облигации равен 80 % Номинальной стоимости одной Облигации. Если в Предельную дату оценки Показателем базового актива ДОСТИГНУТ Барьер погашения, то размер выплаты при погашении по каждой Облигации равен 79 % Номинальной стоимости одной Облигации. Сумма выплаты на одну Облигацию при погашении, если Событие дестабилизации наступает, определяется в соответствии с Решением о выпуске.	
6 ИНЫЕ СВЕДЕНИЯ ПО ОБЛИГАЦИЯМ		

Дилеры-ориентеры	<u>Дилер-ориентир 1:</u> полное фирменное наименование: Акционерное общество «Сбербанк КИБ» сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО «Сбербанк КИБ» для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739007768 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) ИНН (при наличии): 7710048970 место нахождения и адрес: Российская Федерация, г. Москва, 117312, г. Москва, ул. Вавилова, д. 19
	<u>Дилер-ориентир 2:</u> полное фирменное наименование: Банк ВТБ (публичное акционерное общество) сокращенное фирменное наименование (при наличии): Банк ВТБ (ПАО) для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739609391 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) ИНН (при наличии): 7702070139 место нахождения и адрес: Российская Федерация, г. Санкт-Петербург, 191144, г. Санкт-Петербург, Дегтярный переулок, д. 11, лит. А
	<u>Дилер-ориентир 3:</u> полное фирменное наименование: Акционерное общество «Инвестиционная компания «ФИНАМ» сокращенное фирменное наименование (при наличии): АО «ФИНАМ» для российских юридических лиц – ОГРН: 1027739572343 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) ИНН (при наличии): 7731038186 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.