

РЕШЕНИЕ О ВЫПУСКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ

Общество с ограниченной ответственностью
«Специализированное финансовое общество
БКС Структурные Ноты»

облигации структурные бездокументарные серии 27, процентные дисконтные
неконвертируемые с залоговым обеспечением

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

на основании решения о размещении ценных бумаг, принятого единственным участником Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество БКС Структурные Ноты» 28.12.2023, решение от 28.12.2023, № 32.

Место нахождения эмитента (в соответствии с его уставом): г. Москва.

Генеральный директор Общества с ограниченной ответственностью «ТМФ РУС» - управляющей организации Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество БКС Структурные Ноты», действующей на основании решения единственного учредителя Общества с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество БКС Структурные Ноты» (Решение № 1 от 02.04.2019) и договора о передаче полномочий единоличного исполнительного органа № б/н от 30.05.2019

Швецов Дмитрий Валерьевич

Исполнение обязательств по облигациям настоящего выпуска обеспечивается залогом денежных требований в соответствии с условиями, установленными в настоящем решении о выпуске ценных бумаг.

Лицом, предоставляющим обеспечение по облигациям настоящего выпуска, является Общество с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество БКС Структурные Ноты».

Далее в настоящем документе будут использоваться следующие термины:

«**Банк залогового счета**» означает российскую кредитную организацию, в которой открыт Залоговый счет.

«**Биржа**» означает Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС», ПАО Московская Биржа (ОГРН 1027739387411).

«**Дополнительный доход**» означает дополнительный доход по Облигациям, особенности порядка определения и выплаты которого определяются в п.5.4.2 Решения о выпуске.

«**Закон о РЦБ**» означает Федеральный закон от 22.04.1996 39-ФЗ «О рынке ценных бумаг».

«**Залоговый счет**» означает счет Эмитента, реквизиты которого приведены в п.7.3.1.1 Решения о выпуске.

«**Контрольная ценная бумага**» означает ценную бумагу, входящую в корзину ценных бумаг (пп. (А) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске), порядок определения которой в контрольную дату устанавливается в Решении о ключевых условиях с учетом п. 5.3.1.4. Решения о выпуске. В корзину ценных бумаг может входить одна ценная бумага. В этом случае п.5.3.1.4 Решения о выпуске не применяется, а ценная бумага, входящая в корзину ценных бумаг, всегда является Контрольной ценной бумагой.

«**Лента новостей**» означает информационный ресурс, обновляемый в режиме реального времени и предоставляемый информационным агентством, аккредитованным Банком России на проведение действий по раскрытию информации о ценных бумагах и об иных финансовых инструментах.

«**НРД**» означает Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий», осуществляющее централизованный учет прав на Облигации.

«**Облигации**» означает облигации, размещаемые в соответствии с Решением о выпуске.

«**Плановый торговый день**» означает любой день, в который соответствующая биржа расчета должна быть открыта в соответствии с графиком работы для проведения торгов в режиме основных торгов.

«**Потенциальное событие корректировки**» означает любое из событий, указанное в п.1.1 Приложения 1 к Решению о выпуске.

«**Решение о выпуске**» означает настоящее решение о выпуске ценных бумаг.

«**Решение о ключевых условиях**» означает одно или несколько решений уполномоченного органа Эмитента или уполномоченного должностного лица Эмитента, содержащее (-ие) ключевые условия сделки. Особенности содержания Решения о ключевых условиях и внесения изменений в Решение о ключевых условиях определены Решением о выпуске, в т.ч. п.12.1 Решения о выпуске. Под Решением о ключевых условиях понимается Решение о ключевых условиях со всеми изменениями к нему.

«**Событие корректировки**» означает любое из событий, указанное в п.2.1 Приложения 1 к Решению о выпуске.

«**События нарушения расчета**» определено в п.4.1 Приложения 1 к Решению о выпуске.

«**Событие выплаты в альтернативной валюте**» – любое событие, в связи с которым исполнение Эмитентом своих обязательств по Облигациям в китайских юанях не может быть выполнено в установленный для исполнения обязательства срок или такое исполнение существенно затруднено в установленный для исполнения обязательства срок, или является противоправным, в том числе, но, не ограничиваясь, вследствие: отказа/приостановления со стороны соответствующей организации финансового рынка предоставления услуг или отказа/приостановления принятия выплаты по Облигациям, или отказа/приостановления осуществления операции, связанной с выплатой по Облигациям, или введения запрета или иного ограничения, наложенного нормативным правовым актом, решением, предписанием или иным обязательным к исполнению документом Российской Федерации (ее уполномоченного государственного органа, суда или иного уполномоченного субъекта применения права, в том числе Банка России либо какого-либо уполномоченного органа местного самоуправления), иностранного государства (его уполномоченного государственного органа, суда или иного уполномоченного субъекта применения права, в том числе центрального банка либо органа банковского надзора иностранного государства либо какого-либо уполномоченного органа местного самоуправления) или международной (межгосударственной, межправительственной) организации (ее уполномоченного органа или иного уполномоченного субъекта применения права или межгосударственного объединения). Событие выплаты в альтернативной валюте считается наступившим и в том случае, когда Эмитент не может осуществить исполнение своих

обязательств по Облигациям в китайских юанях через НРД по причинам, связанным с НРД. Отслеживание наличия События выплаты в альтернативной валюте осуществляется применительно к каждой выплате по Облигации отдельно.

«**Страница в сети Интернет**» означает страницу в сети Интернет, предоставляемую Эмитенту одним из аккредитованных агентств, по адресу: <https://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=37824>. В тех случаях, когда Решением о выпуске предусмотрена публикация в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет, – соответствующая информация должна быть сначала раскрыта в Ленте новостей, а после этого на Странице в сети Интернет.

«**Указ № 81**» означает Указ Президента Российской Федерации от 01.03.2022 № 81 «О дополнительных временных мерах экономического характера по обеспечению финансовой стабильности Российской Федерации».

«**Эмитент**» означает Общество с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество БКС Структурные Ноты» (ОГРН 1197746248963).

1. ВИД, КАТЕГОРИЯ (ТИП), ИДЕНТИФИКАЦИОННЫЕ ПРИЗНАКИ ЦЕННЫХ БУМАГ

Вид ценных бумаг: облигации

Иные идентификационные признаки размещаемых ценных бумаг: облигации структурные бездокументарные серии 27, процентные дисконтные неконвертируемые с залоговым обеспечением.

2. УКАЗАНИЕ НА СПОСОБ УЧЕТА ПРАВ НА ОБЛИГАЦИИ

Предусмотрен обязательный централизованный учет прав на Облигации.

Сведения о депозитарии, который будет осуществлять централизованный учет прав на Облигации:

- Полное фирменное наименование: Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий»
- Сокращенное фирменное наименование: НКО АО НРД
- Место нахождения: Российская Федерация, город Москва
- ОГРН: 1027739132563

В случае прекращения деятельности НРД в связи с его реорганизацией централизованный учет прав на Облигации будет осуществляться его правопреемником в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации и (или) нормативных актов в сфере финансовых рынков, а также внутренними документами юридического лица, являющегося правопреемником НРД. В тех случаях, когда в Решении о выпуске упоминается НРД, подразумевается НРД или его правопреемник.

3. НОМИНАЛЬНАЯ СТОИМОСТЬ КАЖДОЙ ЦЕННОЙ БУМАГИ ВЫПУСКА

1000 (Одна тысяча) китайских юаней.

4. ПРАВА ВЛАДЕЛЬЦА КАЖДОЙ ЦЕННОЙ БУМАГИ ВЫПУСКА

4.1. Размещаемые ценные бумаги не являются привилегированными акциями.

4.2. Каждая Облигация предоставляет ее владельцу следующий равный объем прав и сроки их осуществления вне зависимости от времени приобретения Облигации:

- право получить от Эмитента при погашении Облигации в предусмотренный ею срок номинальную стоимость Облигации в зависимости от наступления или ненаступления обстоятельства, определенного в п.5.3.1.1 Решения о выпуске.
- право получить:
 - фиксированный купонный доход (п.5.4.1 Решения о выпуске);
 - Дополнительный доход (п.5.4.2 Решения о выпуске);
- иные права, предусмотренные законодательством Российской Федерации.

4.2.1. Данный выпуск является выпуском Облигаций с обеспечением. Обеспечением по Облигациям является залог прав по договору банковского счета. Информация о залоговом обеспечении приводится в п.7 Решения о выпуске.

В случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Эмитентом своих обязательств по Облигациям, владельцы Облигаций или уполномоченные ими лица имеют право обратиться с требованием об исполнении обязательств по Облигациям в соответствии с условиями предоставления обеспечения в порядке, предусмотренном п.7 Решения о выпуске.

Требования владельцев Облигаций, не удовлетворенные за счет средств, полученных в результате реализации заложенных в обеспечение по Облигациям прав по договору банковского счета при обращении на них взыскания, считаются погашенными.

Облигация с обеспечением предоставляет ее владельцу все права, возникающие из такого обеспечения в соответствии с условиями обеспечения. С переходом прав на Облигацию с обеспечением к новому владельцу (приобретателю) переходят все права, вытекающие из такого обеспечения. Передача прав, возникших из предоставленного обеспечения, без передачи прав на Облигацию является недействительной.

Сведения об обеспечении исполнения обязательств по Облигациям и порядок действий владельцев Облигаций и/или уполномоченных ими лиц в случае неисполнения Эмитентом своих обязательств по Облигациям содержатся в п.7 Решения о выпуске.

4.2.2. Облигации являются структурными облигациями по смыслу статьи 27.1-1 Закона о РЦБ. Владельцы структурных облигаций имеют право на получение выплат по ним в зависимости от наступления или ненаступления обстоятельства, определенного в п.5.3.1.1 Решения о выпуске.

4.2.3. Размещаемые ценные бумаги не являются облигациями без срока погашения.

4.3. Размещаемые ценные бумаги не являются облигациями с ипотечным покрытием.

4.4. Размещаемые ценные бумаги не являются опционами эмитента.

4.5. Размещаемые ценные бумаги не являются конвертируемыми ценными бумагами.

4.6. Размещаемые ценные бумаги являются ценными бумагами, предназначенными для квалифицированных инвесторов.

Облигации могут принадлежать только квалифицированным инвесторам, за исключением случаев, когда лицо приобрело указанные ценные бумаги в результате универсального правопреемства, конвертации, в том числе при реорганизации, распределения имущества ликвидируемого юридического лица, и иных случаев, установленных Банком России.

Депозитарии вправе зачислять Облигации на счет депо владельца, только если депонент является квалифицированным инвестором либо не является квалифицированным инвестором, но приобрел указанные ценные бумаги в результате универсального правопреемства, конвертации, в том числе при реорганизации, распределения имущества ликвидируемого юридического лица и в иных случаях, установленных законодательством Российской Федерации или нормативными актами Банка России.

Облигации допускаются к обращению на биржевом и внебиржевом рынках только среди квалифицированных инвесторов. Приобретение и отчуждение Облигаций, а также предоставление (принятие) Облигаций в качестве обеспечения исполнения обязательств могут осуществляться только через брокеров. Настоящее правило не распространяется на квалифицированных инвесторов в силу федерального закона при совершении ими указанных сделок, а также на случаи, когда лицо приобрело указанные ценные бумаги в результате универсального правопреемства, конвертации, в том числе при реорганизации, распределения имущества ликвидируемого юридического лица, и на иные случаи, установленные законодательством Российской Федерации или нормативными актами Банка России.

Если владельцем Облигаций становится лицо, не являющееся квалифицированным инвестором или утратившее статус квалифицированного инвестора, это лицо вправе произвести отчуждение таких ценных бумаг только через брокера.

Облигации не могут предлагаться неограниченному кругу лиц, в том числе с использованием рекламы, а также лицам, не являющимся квалифицированными инвесторами.

5. ПОРЯДОК И УСЛОВИЯ ПОГАШЕНИЯ И ВЫПЛАТЫ ДОХОДОВ ПО ОБЛИГАЦИЯМ

5.1. Форма погашения облигаций

Погашение Облигаций производится денежными средствами в китайских юанях в безналичном порядке. Возможность и условия выбора владельцами Облигаций формы погашения Облигаций не предусмотрены.

Если по состоянию на 19 часов 00 минут (по московскому времени) дня, наступающего за 3 (Три) рабочих дня до

даты погашения Облигаций (включая дату погашения Облигаций), установленной в Решении о ключевых условиях, имеет место Событие выплаты в альтернативной валюте, Эмитент вправе осуществить выплаты по Облигациям в альтернативной валюте в соответствии с пунктом 12.3 Решения о выпуске.

5.2. Срок погашения облигаций

Срок погашения Облигаций или порядок его определения устанавливается в Решении о ключевых условиях уполномоченным органом управления (уполномоченным должностным лицом) Эмитента до начала размещения Облигаций.

Срок погашения Облигаций, определенный в Решении о ключевых условиях, должен предусматривать, что погашение Облигаций осуществляется в наиболее раннюю из следующих дат:

- (i) конкретная календарная дата, наступающая после даты начала размещения Облигаций, либо дата, наступающая через определенное количество календарных дней с даты начала размещения Облигаций;
- (ii) дата, наступающая через определенное количество календарных дней с контрольной даты для целей погашения Облигаций, порядок определения которой указан в Решении о ключевых условиях.

Контрольная дата для целей погашения Облигаций должна быть определена таким образом, чтобы ее наступление не зависело от усмотрения Эмитента.

Во избежание сомнений, контрольной датой для целей погашения Облигаций является контрольная дата, в которую произошло барьерное событие, а также, если это предусмотрено Решением о ключевых условиях, дата, в которую произошло Событие корректировки и/или Потенциальное событие корректировки.

Информация о сроке погашения Облигаций или порядке его определения раскрывается до начала размещения Облигаций путем публикации Решения о ключевых условиях в порядке, предусмотренном п.12.1.1 Решения о выпуске.

Дата начала и окончания погашения Облигаций совпадают.

5.3. Порядок и условия погашения облигаций.

Эмитент исполняет обязанность по осуществлению денежных выплат в счет погашения по ценным бумагам путем перечисления денежных средств НРД. Указанная обязанность считается исполненной Эмитентом с даты поступления денежных средств на счет НРД.

Владельцы Облигаций получают причитающиеся им денежные выплаты в счет погашения Облигаций через депозитарий, осуществляющий учет прав на Облигации, депонентами которого они являются. Депозитарный договор должен содержать порядок передачи депозитарием депоненту выплат по ценным бумагам.

Передача денежных выплат в счет погашения Облигаций осуществляется депозитарием в соответствии с порядком, предусмотренным статьей 8.7 Закона о РЦБ с особенностями в зависимости от способа учета прав на Облигации.

Если на момент совершения Эмитентом действий по осуществлению выплат по Облигациям законодательством Российской Федерации будут установлены условия, порядок и (или) правила (требования), отличные от тех, которые содержатся в Решении о выпуске, исполнение обязательств Эмитентом по осуществлению выплат по Облигациям будет осуществляться с учетом требований законодательства Российской Федерации, действующих на момент совершения соответствующих действий.

Если дата погашения Облигаций приходится на нерабочий день, то перечисление надлежащей суммы производится в первый рабочий день, следующий за датой погашения Облигаций. Владелец Облигаций не имеет права требовать начисления процентов или какой-либо иной компенсации за такую задержку в платеже.

5.3.1. Порядок определения выплат по каждой структурной облигации при ее погашении.

5.3.1.1. Обстоятельство, от наступления или ненаступления которого зависит осуществление выплат по структурным облигациям.

Обстоятельство, от наступления или ненаступления которого зависит осуществление выплат по Облигациям:

изменение цены на Контрольную ценную бумагу.

Осуществление выплат по Облигациям в связи с изменением цены на Контрольную ценную бумагу зависит от наступления или ненаступления барьерного события.

Под барьерным событием понимается достижение в контрольную дату цены ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг (или цен нескольких ценных бумаг) такого уровня, который превышает, равен или составляет менее фиксированного уровня (фиксированных уровней; применимых цен), или находится в течение определенного периода времени выше, равен или ниже фиксированного уровня (фиксированных уровней; применимых цен), или находится в пределах (вне пределов) определенного диапазона, указанного Эмитентом в Решении о ключевых условиях отдельно для каждого барьерного события, или выполняется иное, установленное Эмитентом в Решении о ключевых условиях, соотношение между ценой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг (или ценами нескольких ценных бумаг) и фиксированным уровнем (фиксированными уровнями; применимыми ценами).

Содержание барьерного события определяется в Решении о ключевых условиях. В Решении о ключевых условиях может быть предусмотрено несколько барьерных событий.

Конкретные значения уровня (или уровней), при достижении которого (которых) цены ценной бумаги (или цен нескольких ценных бумаг) в результате изменения цены ценной бумаги (или цен нескольких ценных бумаг) барьерное событие считается наступившим (уровень барьера), определяются в Решении о ключевых условиях. Уровень барьера устанавливается Эмитентом отдельно для каждого барьерного события.

Моментом наступления барьерного события является контрольная дата, в которую достигнут уровень барьера. Даты, на которые проверяется наступление соответствующего барьерного события (контрольные даты), определяются в Решении о ключевых условиях.

Во избежание сомнений, Решением о ключевых условиях может быть предусмотрено, что барьерным событием является достижение в контрольную дату значением среднего арифметического цен всех ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, уровня барьера.

Информация о наступлении/ненаступлении барьерного события в контрольную дату раскрывается Эмитентом в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет не позднее следующего рабочего дня с даты получения от расчетного агента соответствующего уведомления о наступлении/ненаступлении барьерного события в контрольную дату. В сообщении о наступлении барьерного события указывается дата погашения Облигаций, а также размер выплат на одну Облигацию.

5.3.1.2. Размер выплат по структурной облигации.

А) Размер выплат по Облигации при погашении в дату, определенную в соответствии с пп.(ii) п.5.2. Решения о выпуске (при наступлении барьерного события в контрольную дату для целей погашения Облигаций, предшествующую дате погашения), определяется по формуле:

$$Rep_1 = \min (Nom; X_{CALC}) * K + IntF + IntB, \text{ где:}$$

Rep_1 - размер выплат на одну Облигацию при ее погашении в дату, определенную в соответствии с пп.(ii) п.5.2. Решения о выпуске;

Nom – значение, равное 100 % номинальной стоимости одной Облигации, в китайских юанях;

X_{CALC} – значение, рассчитываемое по формуле: $X_{CALC} = PW / PW_{start} * Nom$, где:

PW - цена Контрольной ценной бумаги по состоянию на контрольную дату, в которую

наступило барьерное событие (контрольная дата для целей погашения Облигаций), определенная в соответствии с пп. (Ж) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске;

PW_{start} - цена Контрольной ценной бумаги по состоянию на дату фиксации, определенная в соответствии с пп. (Ж) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске;

K – корректирующий коэффициент, размер которого определяется в Решении о ключевых условиях;

IntF – означает фиксированный купонный доход (п. 5.4.1 Решения о выпуске) на одну Облигацию. Если соблюдается условие ($PW/PW_{start} < M$), то значение IntF считается равным нулю. Значение M определяется в Решении о ключевых условиях;

IntB – означает Дополнительный доход на одну Облигацию (п.5.4.2 Решения о выпуске). Если соблюдается условие ($PW/PW_{start} < N$), то значение IntB считается равным нулю. Значение N определяется в Решении о ключевых условиях.

Если соблюдается условие ($PW/PW_{start} < L$), то значение Rep_1 считается равным нулю. L определяется в Решении о ключевых условиях.

Если в Решении о ключевых условиях предусмотрено несколько барьерных событий, порядок определения значений переменных K, L, M, N может быть различным для каждого из таких барьерных событий.

Б) Размер выплат по Облигации при погашении Облигаций в дату, отличную от указанной пп. (А) п.5.3.1.2 Решения о выпуске, определяется по формуле:

$$Rep_2 = Nom + IntF_2 + IntB_2.$$

Rep_2 - размер выплат на одну Облигацию в иную дату, отличную от указанной пп. (А) п.5.3.1.2 Решения о выпуске;

$IntF_2$ – означает фиксированный купонный доход (п. 5.4.1 Решения о выпуске) на одну Облигацию;

$IntB_2$ – означает Дополнительный доход на одну Облигацию (п.5.4.2 Решения о выпуске).

Если дата погашения Облигаций, определенная в соответствии пп. (ii) п.5.2. Решения о выпуске, совпадает с датой погашения, определенной в соответствии с пп. (i) п.5.2. Решения о выпуске, размер выплат по Облигации при погашении определяется в соответствии с пп. (А) п.5.3.1.2 Решения о выпуске.

5.3.1.3. Сведения, имеющие значение для выплат по Облигациям.

В Решении о ключевых условиях должны быть определены:

(А) ценные бумаги, входящие в корзину ценных бумаг. Состав корзины ценных бумаг определяется Эмитентом. В корзину ценных бумаг не могут входить ценные бумаги, эмитентом которых является Эмитент или лицо, аффилированное с Эмитентом. В отношении каждой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, в Решении о ключевых условиях указываются сведения, позволяющие идентифицировать такую ценную бумагу, включая информацию об ISIN (International Securities Identification Numbers — международный идентификационный код ценной бумаги) и CFI (Classification of Financial Instruments — классификация финансовых инструментов), присвоенных ценной бумаге на дату публикации Эмитентом Решения о ключевых условиях в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет в порядке, предусмотренном п. 12.1.1 Решения о выпуске.

В корзину ценных бумаг может входить одна ценная бумага. В этом случае п.5.3.1.4 Решения о выпуске не применяется, а ценная бумага, входящая в корзину ценных бумаг, всегда является Контрольной ценной бумагой.

(Б) наименование эмитента каждой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг;

(В) номинальная стоимость и валюта номинальной стоимости каждой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг (номинальная стоимость указывается только для облигаций);

- (Г) биржа расчета для каждой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, или порядок определения биржи расчета, а также валюта определения цены каждой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг;
- (Д) дата (даты) фиксации или порядок определения даты (дат) фиксации. Даты фиксации должны быть определены таким образом, чтобы их наступление не зависело от усмотрения Эмитента;
- (Е) контрольные даты, на которые определяется цена на ценные бумаги, входящие в корзину ценных бумаг, или порядок определения этих дат. Контрольные даты должны быть определены таким образом, чтобы их наступление не зависело от усмотрения Эмитента;
- (Ж) порядок определения цен на каждую ценную бумагу, входящую в корзину ценных бумаг, в даты фиксации, контрольные даты. Недопустимо указание в Решении о ключевых условиях такого порядка определения цен ценных бумаг, при котором значения цен данных ценных бумаг будут зависеть от усмотрения Эмитента.

Особенности порядка определения цен на ценные бумаги, входящие в корзину ценных бумаг, при наступлении Потенциального события корректировки/События корректировки (восполнительные процедуры)¹, указаны в п.3 Приложения 1 к Решению о выпуске;

Особенности порядка определения цен на ценные бумаги, входящие в корзину ценных бумаг, при наступлении События нарушения расчета (восполнительные процедуры) указаны в п. 4.3 Приложения 1 к Решению о выпуске.

Если на дату фиксации/контрольные даты невозможно определить цену в связи с наличием на указанную дату одного из обстоятельств, указанных в п.4.1 Приложения 1 к Решению о выпуске, но при этом в такую дату фиксации/контрольную дату События нарушения расчета не наступило, то цена на ценные бумаги, входящие в корзину ценных бумаг, в даты фиксации/контрольные даты считается равной цене на такие ценные бумаги, определенной на Плановый торговый день, предшествующий дате фиксации/контрольной дате, по состоянию на который отсутствовали обстоятельства, указанные в п.4.1 Приложения 1 к Решению о выпуске.

- (З) порядок (способ) определения Контрольной ценной бумаги из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, путем применения в указанную контрольную дату одного из способов, указанных в п. 5.3.1.4. Решения о выпуске. Если в корзину ценных бумаг входит одна ценная бумага, п.5.3.1.4 Решения о выпуске не применяется, а ценная бумага, входящая в корзину ценных бумаг, всегда является Контрольной ценной бумагой;
- (И) уровень барьера, при достижении которого барьерное событие считается наступившим в контрольную дату;
- (К) значения K, L, M, N, используемых для целей расчета размера выплат по Облигации;
- (Л) иная информация, предусмотренная Решением о выпуске.

Решение о ключевых условиях публикуется Эмитентом в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет в порядке, предусмотренном п. 12.1.1 Решения о выпуске.

5.3.1.4. Контрольная ценная бумага.

Контрольная ценная бумага определяется для каждой контрольной даты способом, определенным в Решении о ключевых условиях. Для каждой контрольной даты в Решении о ключевых условиях может определяться самостоятельный способ определения Контрольной ценной бумаги из числа способов, указанных ниже в настоящем пункте Решения о выпуске.

¹ Если в Решении о ключевых условиях указано, что наступление Потенциальных событий корректировки и/или Событий корректировки влечет применение расчетным агентом восполнительных процедур.

Расчетное значение ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, определяется в соответствии с настоящим пунктом Решения о выпуске.

В Решении о ключевых условиях может быть определен один из следующих способов определения Контрольной ценной бумаги в конкретную контрольную дату:

Способ 1. Контрольной ценной бумагой является ценная бумага из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, расчетное значение которой по состоянию на такую контрольную дату менее расчетного значения любой другой ценной бумаги из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, по состоянию на такую контрольную дату.

Если определенные в соответствии с настоящим способом расчетные значения двух и более ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, являются равными и при этом их значение менее расчетного значения любой другой ценной бумаги из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, по состоянию на контрольную дату, то Контрольная ценная бумага из указанных ценных бумаг, расчетные значения которых равны, определяется расчетным агентом по своему усмотрению.

Способ 2. Контрольной ценной бумагой является ценная бумага из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, расчетное значение которой по состоянию на такую контрольную дату более расчетного значения любой другой ценной бумаги из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, по состоянию на такую контрольную дату.

Если определенные в соответствии с настоящим способом расчетные значения двух и более ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, являются равными и при этом их значение более расчетного значения любой другой ценной бумаги из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, по состоянию на контрольную дату, то Контрольная ценная бумага из указанных ценных бумаг, расчетные значения которых равны, определяется расчетным агентом по своему усмотрению.

Способ 3. Контрольной ценной бумагой является ценная бумага из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, расчетное значение которой по состоянию на такую контрольную дату второе по степени наихудшее из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, по состоянию на такую контрольную дату.

Если в Решении о ключевых условиях для конкретной контрольной даты не указан способ определения Контрольной ценной бумаги, то Контрольная ценная бумага для такой контрольной даты определяется в соответствии со Способом 1.

Порядок определения расчетного значения каждой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, по состоянию на контрольную дату.

Расчетное значение ценной бумаги из числа ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, определяется по формуле:

$$C_p = P_p / P_{pstart}, \text{ где}$$

C_p - расчетное значение ценной бумаги p на контрольную дату;

P_p - цена ценной бумаги p по состоянию на контрольную дату, определенная в соответствии с пп. (Ж) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске;

P_{pstart} - цена ценной бумаги p по состоянию на дату фиксации, определенная в соответствии с пп. (Ж) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске;

p – ценная бумага, входящая в корзину ценных бумаг.

Значение C_p определяется индивидуально для каждой ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг.

Если в корзину ценных бумаг входит одна ценная бумага, п.5.3.1.4 Решения о выпуске не применяется, а ценная бумага, входящая в корзину ценных бумаг, всегда является Контрольной ценной бумагой.

5.3.1.5. Потенциальные события корректировки и/или События корректировки.

В Решении о ключевых условиях может быть указано, что дата, в которую выявлено наступление Потенциального события корректировки и/или События корректировки, является контрольной датой для целей погашения Облигаций и влечет те же последствия, что наступление барьерного события.

В этом случае размер выплат по Облигации в случае наступления Потенциального события корректировки и/или События корректировки определяется в соответствии с пп. (А) п.5.3.1.2 Решения о выпуске.

5.4. Порядок определения дохода, выплачиваемого по каждой облигации

Владельцы Облигаций имеют право получить фиксированный купонный доход и Дополнительный доход.

Если дата погашения и выплаты дохода по Облигациям приходится на нерабочий день, то перечисление надлежащей суммы производится в следующий рабочий день. Владелец Облигаций не имеет права требовать начисления процентов или какой-либо иной компенсации за такую задержку в платеже.

5.4.1. Фиксированный купонный доход

Владельцы Облигаций имеют право на получение фиксированного купонного дохода.

Облигации имеют один купонный период для целей выплаты фиксированного купонного дохода. Купонный период для целей выплаты фиксированного купонного дохода начинается в дату начала размещения Облигаций и оканчивается в дату погашения Облигаций.

Фиксированный купонный доход по Облигациям выплачивается в дату окончания купонного периода для целей выплаты фиксированного купонного дохода (при погашении Облигаций).

Размер фиксированного купонного дохода определяется Эмитентом не позднее даты начала размещения Облигаций.

Размер фиксированного купонного дохода определяется Эмитентом в Решении о ключевых условиях.

Размер фиксированного купонного дохода по Облигациям определяется в китайских юанях.

5.4.2. Дополнительный доход

В Решении о ключевых условиях может быть предусмотрено несколько видов Дополнительных доходов с отличными друг от друга размерами и сроками выплаты.

В отношении каждого вида Дополнительного дохода Решение о ключевых условиях должно содержать:

- размер Дополнительного дохода или порядок его определения², в том числе размер Дополнительного дохода, выплачиваемого по каждому купонному периоду для целей Дополнительного дохода, или порядок его определения³;
- определенные периоды выплаты Дополнительного дохода (купонные периоды для целей Дополнительного дохода) или порядок их определения;
- срок (даты) выплаты Дополнительного дохода или порядок его определения.

Порядок определения размера Дополнительного дохода, указанный в Решении о ключевых условиях, может предусматривать зависимость размера Дополнительного дохода от значения изменения цен на ценные бумаги, входящие в корзину ценных бумаг (пп.(А) п. 5.3.1.3 Решения о выпуске).

Недопустимо указание в Решении о ключевых условиях такого порядка определения размера выплат Дополнительного дохода по Облигациям, при котором размер соответствующих выплат будет зависеть от

² В виде формулы с переменными (курс определенной иностранной валюты, котировка определенной ценной бумаги у организатора торговли и другие переменные), значения которых не могут изменяться в зависимости от усмотрения Эмитента.

³ В виде формулы с переменными (курс определенной иностранной валюты, котировка определенной ценной бумаги у организатора торговли и другие переменные), значения которых не могут изменяться в зависимости от усмотрения Эмитента.

усмотрения Эмитента.

Размер Дополнительного дохода по Облигациям определяется в китайских юанях.

Информация о размере Дополнительного дохода или порядке его определения, о периодах выплаты Дополнительного дохода (купонных периодах для целей Дополнительного дохода) или порядке их определения раскрывается до начала размещения Облигаций путем публикации Решения о ключевых условиях в порядке, предусмотренном п.12.1.1 Решения о выпуске.

5.4.3. Дисконт

В случае размещения Облигаций по цене ниже их номинальной стоимости по Облигациям будет выплачиваться дисконтный доход. Дисконтный доход по каждой Облигации определяется как разница между суммой, выплачиваемой при погашении Облигаций (не включая фиксированный купонный доход и Дополнительный доход, выплачиваемый при погашении или одновременно с погашением Облигаций) в расчете на одну Облигацию, и ценой размещения одной Облигации, а если такая разница будет принимать отрицательное значение, дисконтный доход будет считаться равным нулю.

5.5. Порядок и срок выплаты дохода по облигациям

Срок (дата) выплаты дохода по облигациям или порядок его определения.

Фиксированный купонный доход по Облигациям выплачивается в дату окончания купонного периода для целей выплаты фиксированного купонного дохода (при погашении Облигаций).

Дополнительный доход (п.5.4.2 Решения о выпуске) выплачивается в соответствующие даты выплаты Дополнительного дохода, определенные Решением о ключевых условиях.

Если дата выплаты дохода по Облигациям приходится на нерабочий день, то перечисление подлежащей суммы производится в первый рабочий день, следующий за таким нерабочим днем. Владелец Облигации не имеет права требовать начисления процентов или какой-либо иной компенсации за такую задержку в платеже.

Выплата (передача) дохода по Облигациям производится в соответствии с порядком, установленным действующим законодательством Российской Федерации.

Выплата (передача) дохода по Облигациям производится денежными средствами в безналичном порядке в китайских юанях. Выплата (передача) дохода по Облигациям в неденежной форме не предусмотрена.

Если по состоянию на 19 часов 00 минут (по московскому времени) дня, наступающего за 3 (Три) рабочих дня до даты выплаты Эмитентом дохода по Облигациям, установленной в Решении о ключевых условиях, (включительно) имеет место Событие выплаты в альтернативной валюте, Эмитент вправе осуществить выплаты по Облигациям в альтернативной валюте в соответствии с пунктом 12.3 Решения о выпуске.

Эмитент исполняет обязанность по осуществлению выплат по Облигациям путем перечисления денежных средств НРД. Указанная обязанность считается исполненной Эмитентом с даты поступления денежных средств на счет НРД.

Владельцы Облигаций и иные лица, осуществляющие в соответствии с федеральными законами права по Облигациям, получают причитающиеся им денежные выплаты в счет выплаты дохода по Облигациям через депозитарий, осуществляющий учет прав на Облигации, депонентами которого они являются.

Передача денежных выплат при выплате дохода по Облигациям осуществляется депозитарием в соответствии с порядком, предусмотренным статьей 8.7 Закона о РЦБ, с особенностями в зависимости от способа учета прав на Облигации.

Доход по неразмещенным Облигациям или по Облигациям, переведенным на счет Эмитента в НРД, не начисляется и не выплачивается.

В случае если на момент совершения действий, связанных с исполнением обязательств Эмитентом по выплате купона по Облигациям, законодательством Российской Федерации будут установлены условия, порядок и (или) правила (требования), отличные от тех, которые содержатся в настоящем пункте, исполнение обязательств Эмитентом по выплате купона по Облигациям будет осуществляться с учетом требований законодательства

Российской Федерации, действующих на момент совершения соответствующих действий.

Выплата дисконтного дохода отдельно от выплаты сумм погашения Облигаций не осуществляется, дисконтным доходом является часть суммы погашения Облигаций согласно определению дисконтного дохода в п. 5.4.3 Решения о выпуске. В связи с тем, что дисконтный доход выплачивается в составе суммы погашения Облигаций, порядок и срок его выплаты соответствуют порядку и сроку погашения Облигаций согласно п.п. 5.1, 5.2, 5.3 и 5.6 Решения о выпуске.

5.6. Порядок и условия досрочного погашения облигаций

Возможность досрочного погашения Облигаций по требованию их владельцев и/или по усмотрению Эмитента не предусмотрена.

Вне зависимости от изложенного выше, в случаях, предусмотренных федеральными законами, владельцы Облигаций имеют право требовать досрочного погашения Облигаций до наступления срока их погашения независимо от указания такого права в Решении о выпуске. В этом случае владельцы вправе предъявлять требования о досрочном погашении Облигаций в порядке и сроки, предусмотренные статьей 17.1 Закона о РЦБ. При досрочном погашении Облигаций по требованию владельцев Эмитентом должны быть исполнены все обязательства перед владельцем Облигаций по выплате номинальной стоимости и дохода. В указанном случае досрочное погашение Облигаций по требованию их владельцев производится денежными средствами в безналичном порядке в китайских юанях.

Если по состоянию на 19 часов 00 минут (по московскому времени) дня, наступающего за 3 (Три) рабочих дня до даты досрочного погашения Облигаций, установленной в Решении о ключевых условиях, (включительно) имеет место Событие выплаты в альтернативной валюте, Эмитент вправе осуществить выплаты по Облигациям в альтернативной валюте в соответствии с пунктом 12.3 Решения о выпуске.

Утрата обеспечения по Облигациям или существенное ухудшение условий такого обеспечения не является существенным нарушением условий исполнения обязательств по Облигациям (пп.4 п.5 ст.17.1 Закона о РЦБ)

Облигации, погашенные Эмитентом досрочно, не могут быть вновь выпущены в обращение.

Облигации не являются облигациями без срока погашения.

Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «зеленые облигации».

Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «адаптационные облигации».

Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «социальные облигации».

Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «облигации устойчивого развития».

Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «инфраструктурные облигации».

5.7. Сведения о платежных агентах по облигациям.

Погашение и (или) выплата (передача) доходов по Облигациям осуществляются Эмитентом без привлечения платежных агентов.

Указывается на возможность назначения эмитентом дополнительных платежных агентов и отмены таких назначений, а также порядок раскрытия информации о таких действиях: не применимо.

5.8. Прекращение обязательств кредитной организации – эмитента по выплате суммы основного долга и невыплаченного процента (купона) по облигациям, а также по финансовым санкциям за неисполнение обязательств по облигациям:

Эмитент не является кредитной организацией.

6. СВЕДЕНИЯ О ПРИОБРЕТЕНИИ ОБЛИГАЦИЙ

6.1. Приобретение эмитентом облигаций по требованию их владельцев.

Возможность приобретения Облигаций по требованию их владельцев с возможностью их последующего

обращения не предусмотрена.

6.2. Приобретение эмитентом облигаций по соглашению с их владельцами:

Предусматривается возможность приобретения Облигаций Эмитентом по соглашению с их владельцами с возможностью их последующего обращения до наступления срока погашения на условиях, определенных Решением о выпуске.

Приобретение Облигаций допускается только после их полной оплаты.

Оплата Облигаций при их приобретении производится денежными средствами в безналичном порядке.

Эмитент имеет право приобретать Облигации путем заключения договоров купли-продажи Облигаций в соответствии с законодательством Российской Федерации, в том числе на основании публичных безотзывных оферт Эмитента.

Эмитент до наступления срока погашения Облигаций вправе погасить приобретенные им Облигации досрочно. Приобретенные Эмитентом Облигации, погашенные им досрочно, не могут быть вновь выпущены в обращение.

Порядок и условия приобретения облигаций их эмитентом

Решение о приобретении Облигаций, в том числе на основании публичных безотзывных оферт, принимается Эмитентом с учетом положений Решения о выпуске. При принятии указанного решения должны быть установлены условия, порядок и сроки приобретения Облигаций.

Возможно неоднократное принятие решений о приобретении Облигаций.

Срок (порядок определения срока), в течение которого эмитентом может быть принято решение о приобретении размещенных им облигаций, и порядок направления предложения о приобретении облигаций:

Эмитент может принять решение о приобретении размещенных им Облигаций по соглашению с их владельцами не позднее, чем за 7 рабочих дней до начала срока, в течение которого владельцами Облигаций может быть предъявлено требование к Эмитенту о приобретении Облигаций.

Предложение о приобретении Облигаций по соглашению с их владельцами направляется Эмитентом владельцам Облигаций путем публикации сообщения о принятом решении о приобретении Облигаций по соглашению с владельцами Облигаций (в т.ч. в форме публичных безотзывных оферт Эмитента) в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет.

В случае принятия владельцами Облигаций предложения Эмитента об их приобретении в отношении большего количества Облигаций, чем указано в таком предложении, Эмитент приобретает Облигации у владельцев пропорционально заявленным требованиям при соблюдении условия о приобретении только целого количества Облигаций. В связи с этим владелец Облигаций, подавший или по поручению которого подано требование к Эмитенту о приобретении Облигаций соглашается с тем, что его требование к Эмитенту о приобретении Облигаций может быть акцептовано полностью или в части.

Решение уполномоченного органа управления Эмитента о приобретении Облигаций по соглашению с владельцами Облигаций должно содержать:

- дату принятия решения о приобретении (выкупе) Облигаций;
- серию, регистрационный номер и дату регистрации выпуска Облигаций;
- количество приобретаемых Облигаций;
- порядок и срок заявления владельцами требований к Эмитенту о приобретении принадлежащих им Облигаций на установленных в решении о приобретении Облигаций и изложенных в опубликованном сообщении о приобретении Облигаций условиях, и который не может быть менее 5 рабочих дней;
- дату начала приобретения Эмитентом Облигаций;
- дату окончания приобретения Облигаций;

- цену приобретения Облигаций или порядок ее определения;
- порядок и условия приобретения Облигаций, в том числе валюту приобретения, а также способ определения обменного курса и дату (даты) определения обменного курса при необходимости;
- срок оплаты приобретаемых Облигаций;
- если приобретение осуществляется на торгах - полное и сокращенное фирменное наименование агента по приобретению, его место нахождения, ИНН (если применимо), ОГРН (если применимо), сведения о реквизитах его лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг.

Срок (порядок определения срока) приобретения облигаций их эмитентом:

Облигации приобретаются в дату (даты) приобретения Облигаций, определенную (определенные) соответствующим решением о приобретении Облигаций.

Цена (порядок определения цены) приобретения облигаций их эмитентом:

Цена приобретения Облигаций или порядок ее определения в виде формулы с переменными, значения которых не могут изменяться в зависимости от усмотрения Эмитента, определяется соответствующим решением о приобретении Облигаций.

Порядок реализации лицами, осуществляющими права по ценным бумагам, права требовать приобретения облигаций:

Лицо, осуществляющее права по Облигациям, реализует право требовать приобретения принадлежащих ему Облигаций по правилам, установленным действующим законодательством Российской Федерации.

Порядок и срок заявления владельцами требований к Эмитенту о приобретении Облигаций определяются соответствующим решением о приобретении Облигаций в зависимости от установленного порядка приобретения.

Порядок и условия приобретения облигаций их эмитентом:

Порядок и условия приобретения Облигаций их Эмитентом определяются соответствующим решением о приобретении Облигаций.

В случае, если приобретение Облигаций будет осуществляться путем заключения договоров купли-продажи Облигаций на торгах, проводимых биржей, через удовлетворение адресных заявок на продажу Облигаций, поданных с использованием системы торгов биржи в соответствии с правилами торгов биржи, действующими на дату проведения торгов, приобретение Облигаций будет осуществляться с учетом того, что (i) Эмитент будет действовать с привлечением агента по приобретению; (ii) решение о назначении или о смене лица, которое будет исполнять функции агента по приобретению, должно быть принято Эмитентом не позднее, чем за 7 рабочих дней до начала срока, в течение которого владельцами может быть предъявлено требование к Эмитенту о приобретении Облигаций.

Порядок раскрытия (предоставления) информации о порядке и условиях приобретения облигаций их эмитентом, а также об итогах приобретения облигаций их эмитентом:

В случае принятия Эмитентом решения о приобретении Облигаций по соглашению с их владельцем (владельцами), в том числе на основании публичных безотзывных ofert, информация о таком приобретении раскрывается Эмитентом в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет не позднее, чем за 7 рабочих дней до начала срока заявления требований к Эмитенту о приобретении Облигаций.

Данное сообщение должно содержать следующую информацию:

- дату принятия решения о приобретении (выкупе) Облигаций;
- серию, регистрационный номер и дату регистрации выпуска Облигаций;
- количество приобретаемых Облигаций;
- порядок и срок заявления владельцами требований к Эмитенту о приобретении принадлежащих им Облигаций на установленных в решении о приобретении Облигаций и изложенных в

опубликованном сообщении о приобретении Облигаций условиях, и который не может быть менее 5 (Пяти) рабочих дней;

- дату начала приобретения Эмитентом Облигаций;
- дату окончания приобретения Облигаций;
- цену приобретения Облигаций или порядок ее определения;
- порядок и условия приобретения Облигаций;
- срок оплаты приобретаемых Облигаций;
- если приобретение осуществляется на торгах - полное и сокращенное фирменное наименование агента по приобретению, его место нахождения, ИНН (если применимо), ОГРН (если применимо), сведения о реквизитах его лицензии профессионального участника рынка ценных бумаг.

Информация об исполнении Эмитентом обязательств по приобретению Облигаций (в том числе о количестве приобретенных Облигаций) раскрывается Эмитентом в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет не позднее одного рабочего дня с даты приобретения (даты окончания установленного срока приобретения) Облигаций.

Информация о назначении Эмитентом агента по приобретению и отмене таких назначений раскрывается Эмитентом в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет не позднее чем за 7 (Семь) рабочих дней до начала срока, в течение которого владельцами может быть предъявлено требование к Эмитенту о приобретении Облигаций.

7. СВЕДЕНИЯ ОБ ОБЕСПЕЧЕНИИ ИСПОЛНЕНИЯ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ ПО ОБЛИГАЦИЯМ ВЫПУСКА

7.1. Вид предоставляемого обеспечения

Вид предоставляемого обеспечения: залог.

7.2. Сведения о лице, предоставляющем обеспечение исполнения обязательств по облигациям.

Лицом, предоставляющим обеспечение по облигациям, является Эмитент.

Полное фирменное наименование: Общество с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество БКС Структурные Ноты».

Сокращенное фирменное наименование: ООО «СФО БКС Структурные Ноты».

Место нахождения⁴: г. Москва.

Основной государственный регистрационный номер: 1197746248963.

Эмитент обязан раскрывать информации о его финансово-хозяйственной деятельности, в том числе в форме отчета эмитента и сообщений о существенных фактах.

Исполнение обязательств по Облигациям не обеспечивается государственной или муниципальной гарантией.

7.3. Условия обеспечения исполнения обязательств по облигациям.

7.3.1. Условия обеспечения обязательств по облигациям с залоговым обеспечением (за исключением облигаций с ипотечным покрытием).

Предмет залога:

Обеспечением по Облигациям является залог прав по договору банковского счета.

⁴ В соответствии с его уставом.

Владельцы Облигаций имеют право на получение в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения обязательств по Облигациям удовлетворения требований по принадлежащим им Облигациям из стоимости заложенного имущества путем обращения на него взыскания в порядке, указанном в настоящем пункте, либо из сумм возмещения, причитающихся залогодателю в случае реквизиции или национализации заложенного имущества, преимущественно перед другими кредиторами залогодателя – Эмитента.

Стоимость заложенного имущества:

Для целей Решения о выпуске стоимость заложенного имущества (прав по договору банковского счета) определяется равной сумме денежных средств, находящихся на Залоговом счете.

Эмитент должен обеспечить, чтобы по состоянию на дату начала размещения Облигаций остаток средств на Залоговом счете составил не менее 10 000 российских рублей.

Объем требований владельцев облигаций, обеспечиваемых залогом:

Залогом обеспечивается исполнение всех обязательств Эмитента по Облигациям, включая исполнение основного обязательства Эмитента по выплате номинальной стоимости Облигаций их владельцам (в том числе, в случае досрочного погашения) и выплате дохода по Облигациям, а также по выплате иных сумм, причитающихся в пользу владельцев Облигаций за неисполнение (несвоевременное исполнение) указанных обязательств.

Страхование риска убытков, связанных с неисполнением обязательств по закладываемым денежным требованиям (наименование страховщика, страхователя и выгодоприобретателя, их места нахождения, размер страховой суммы, описание страхового случая, номер, дата заключения и срок действия договора страхования):

не производилось.

Порядок обращения взыскания на предмет залога:

Обращение взыскания на права по договору банковского счета осуществляется по решению суда в соответствии с процедурой, предусмотренной Законом о РЦБ и ГК РФ.

При обращении взыскания на заложенные права по договору банковского счета требования залогодержателей - владельцев Облигаций удовлетворяются путем списания денежных средств с такого Залогового счета и направления указанных денежных средств на исполнение обязательств по Облигациям в соответствии со ст. 358.14 ГК РФ.

Залогодержатели - владельцы Облигаций имеют право заявлять Эмитенту требования о получении денежных средств от реализации находящихся в залоговом обеспечении денежных требований в размере, не превышающем сумму обязательств, исполнение которого обеспечено залогом соответствующих денежных требований.

Сумма, вырученная от реализации заложенных прав, входящих в состав залогового обеспечения, распределяется между залогодержателями (владельцами Облигаций).

Если сумма, вырученная при реализации заложенных прав, входящих в состав залогового обеспечения, превышает размер обеспеченных залогом требований по Облигациям, разница после удержания из нее сумм, необходимых для покрытия расходов, связанных с обращением взыскания этих прав и их реализацией, возвращается Эмитенту.

Денежные средства, полученные от реализации заложенных прав, входящих в состав залогового обеспечения, перечисляются в пользу владельцев Облигаций в безналичном порядке в российских рублях. При отсутствии События выплаты в альтернативной валюте, требования залогодержателей - владельцев Облигаций на получение выплат по Облигациям в китайских юанях удовлетворяются за счет денежных средств, полученных от реализации заложенных прав, в российских рублях с учетом курса китайского юаня к российскому рублю, установленному Банком России и действующему по состоянию на дату вступления в законную силу судебного акта об обращении взыскания на заложенные права по договору банковского счета.

Требования владельцев Облигаций, не удовлетворенные за счет средств, полученных в результате реализации заложенных в обеспечение по Облигациям денежных требований (в виде прав по договору банковского счета) при обращении на них взыскания, считаются погашенными.

7.3.1.1. Условия обеспечения обязательств по облигациям с залоговым обеспечением денежными требованиями (в том числе будущими денежными требованиями)

Иные выпуски облигаций Эмитента и (или) требования кредиторов по договорам Эмитента, обеспеченные тем же залогом:

отсутствуют.

Сведения о запретах и ограничениях по распоряжению денежными средствами на Залоговом счете. Исчерпывающий перечень и предельный размер выплат, для осуществления которых эмитент вправе использовать денежные суммы, зачисленные на залоговый счет:

денежные средства, зачисленные на Залоговый счет, могут быть использованы (списаны с Залогового счета) для осуществления следующих выплат:

- (а) исполнения обязательств по Облигациям. Предельный размер выплат: не более размера обязательств Эмитента по Облигациям;
- (б) возврата ошибочно зачисленных на Залоговый счет денежных средств. Предельный размер выплат: не более ошибочно зачисленных на Залоговый счет сумм.

Ограничения по распоряжению денежными средствами на Залоговом счете в отношении твердой денежной суммы не устанавливаются.

Критерии денежных требований, которые эмитент вправе приобретать за счет находящихся на залоговом счете денежных сумм без согласия владельцев облигаций:

Не применимо. Право Эмитента приобретать денежные требования за счет находящихся на Залоговом счете денежных сумм не предусмотрено.

Сведения об обязательствах, из которых вытекают заложенные денежные требования, и о должниках залогодателя, а также сведения, позволяющие определить (в том числе общим образом) лиц, которые являются или на дату обращения взыскания на предмет залога будут являться должниками по таким обязательствам:

не применимо. Решение о выпуске не предусматривает иного залога, кроме залога прав по договору банковского счета.

Банковские реквизиты Залогового счета:

- Владелец счета (получатель средств): Общество с ограниченной ответственностью «Специализированное финансовое общество БКС Структурные Ноты»
- ИНН/КПП получателя средств: 7743298037/774301001
- Номер счета: 40701810900000000127
- Банк залогового счета:

Полное фирменное наименование: Акционерное общество «БКС Банк»

Сокращенное фирменное наименование: АО «БКС Банк»

Место нахождения: 129110, Россия, Москва, пр-кт. Мира, д.69 стр. 1

ИНН/КПП: 5460000016/770201001

БИК: 044525631

Корреспондентский счет: 30101810145250000631, открытый в ГУ Банка России по Центральному федеральному округу

Эмитент обязан:

- не позднее даты начала размещения Облигаций уведомить Банк залогового счета об условиях залога, устанавливаемого в обеспечение исполнения обязательств по Облигациям, путем направления Банку залогового счета Решения о выпуске, содержащего условия залога прав по Залоговому счету, в составе пакета электронных документов в виде zip-архива совместно с файлом, содержащим усиленную квалифицированную электронную подпись Банка России, которой был подписан пакет электронных документов, представленных на государственную регистрацию вместе с Решением о выпуске;
- в дату фактического размещения первой Облигации направить заказным письмом с уведомлением о вручении, курьером или нарочным уведомление о залоге прав по договору банковского счета в Банк залогового счета.

В момент получения Банком залогового счета уведомления о залоге прав по договору банковского счета (при условии направления в Банк залогового счета копии Решения о выпуске в указанном порядке) в соответствии со ст. 358.11 и п. 1 ст. 358.12 ГК РФ считается заключенным договор залога прав по договору банковского счета в отношении Залогового счета между Эмитентом как залогодателем, владельцами Облигаций как залогодержателями, а также Банком Залогового счета.

Обязанности Банка залогового счета по ведению залогового счета, а также порядок обращения владельцев Облигаций к Банку залогового счета и действий Банка залогового счета в случае неисполнения или ненадлежащего исполнения Эмитентом обязательств перед владельцами Облигаций определяются договором залогового счета.

Банк залогового счета вправе в одностороннем порядке или по соглашению с Эмитентом вносить изменения в договор залогового счета в части установления общих условий отношений Эмитента и Банка залогового счета, порядка проведения операций по Залоговому счету и тарифов на банковское обслуживание Банка залогового счета и других положений договора залогового счета, которые не затрагивают права и законные интересы владельцев Облигаций.

Подлинники документов, удостоверяющих права по Залоговому счету, находятся на хранении у Эмитента.

7.3.1.2. Дополнительные сведения о размещаемых облигациях с залоговым обеспечением денежными требованиями.

7.3.1.2.1. Сведения о лице, осуществляющем учет находящихся в залоге денежных требований и денежных сумм, зачисленных на залоговый счет:

учет осуществляется Эмитентом.

7.3.1.2.2. Сведения об организациях, обслуживающих находящиеся в залоге денежные требования: не применимо. Решение о выпуске не предусматривает иного залога, кроме залога прав по договору банковского счета.

7.3.1.2.3. Информация о формах, способах принятия и объеме рисков, принимаемых первоначальными и (или) последующими кредиторами по обязательствам, денежные требования по которым составляют залоговое обеспечение:

Не применимо. Эмитент является специализированным финансовым обществом, которое осуществляет эмиссию структурных облигаций.

7.3.2. Условия обеспечения обязательств по облигациям с ипотечным покрытием:

размещаемые ценные бумаги не являются облигациями с ипотечным покрытием.

7.3.3. Условия обеспечения обязательств по облигациям, обеспеченным поручительством:

размещаемые ценные бумаги не являются облигациями, обеспеченными поручительством.

7.3.4. Условия обеспечения обязательств по облигациям, обеспеченным гарантией:

размещаемые ценные бумаги не являются облигациями, обеспеченными гарантией.

7.4. Сведения об очередности обеспечения исполнения обязательств по облигациям выпусков, исполнение обязательств по которым обеспечивается за счет того же обеспечения, которое предоставляется по облигациям настоящего выпуска:

такие выпуски облигаций отсутствуют.

8. ДОПОЛНИТЕЛЬНЫЕ СВЕДЕНИЯ О ЗЕЛЕНых ОБЛИГАЦИЯХ, СОЦИАЛЬНЫХ ОБЛИГАЦИЯХ, ОБЛИГАЦИЯХ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ, ИНФРАСТРУКТУРНЫХ ОБЛИГАЦИЯХ, АДАПТАЦИОННЫХ ОБЛИГАЦИЯХ, ОБЛИГАЦИЯХ, СВЯЗАННЫХ С ЦЕЛЯМИ УСТОЙЧИВОГО РАЗВИТИЯ, ОБЛИГАЦИЯХ КЛИМАТИЧЕСКОГО ПЕРЕХОДА.

Целевое использование денежных средств, полученных от размещения Облигаций, не предусмотрено.

- 8.1. В случае если эмитент идентифицирует настоящий выпуск облигаций с использованием слов «зеленые облигации»: не применимо. Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «зеленые облигации».
- 8.2. В случае если эмитент идентифицирует настоящий выпуск облигаций с использованием слов «социальные облигации»: не применимо. Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «социальные облигации».
- 8.2.1. В случае если эмитент идентифицирует настоящий выпуск облигаций с использованием слов «облигации устойчивого развития»: не применимо. Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «облигации устойчивого развития».
- 8.3. В случае если эмитент идентифицирует настоящий выпуск облигаций с использованием слов «инфраструктурные облигации»: не применимо. Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «инфраструктурные облигации».
- 8.4. В случае если эмитент идентифицирует настоящий выпуск облигаций с использованием слов «адаптационные облигации»: не применимо. Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «адаптационные облигации».
- 8.5. В случае если эмитент идентифицирует настоящий выпуск облигаций с использованием слов «облигации, связанные с целями устойчивого развития»: не применимо. Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «облигации, связанные с целями устойчивого развития».
- 8.6. В случае если эмитент идентифицирует настоящий выпуск облигаций с использованием слов «облигации климатического перехода»: не применимо. Эмитент не идентифицирует Облигации с использованием слов «облигации климатического перехода».

9. СВЕДЕНИЯ О ПРЕДСТАВИТЕЛЕ ВЛАДЕЛЬЦЕВ ОБЛИГАЦИЙ

На дату подписания Решения о выпуске представитель владельцев Облигаций Эмитентом не определен.

9(1). СВЕДЕНИЯ О КОМПЕТЕНЦИИ ОБЩЕГО СОБРАНИЯ ВЛАДЕЛЬЦЕВ ОБЛИГАЦИЙ

Указываются вопросы, по которым общее собрание владельцев облигаций вправе принимать решение дополнительно к вопросам, предусмотренным пунктом 1 статьи 29.7 Закона о РЦБ:

такие вопросы Решением о выпуске не предусмотрены.

10. ОБЯЗАТЕЛЬСТВО ЭМИТЕНТА

Эмитент обязуется обеспечить права владельцев Облигаций при соблюдении ими установленного законодательством Российской Федерации порядка осуществления этих прав.

11. ОБЯЗАТЕЛЬСТВО ЛИЦ, ПРЕДОСТАВИВШИХ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ПО ОБЛИГАЦИЯМ

Предоставление третьими лицами обеспечения исполнения обязательств Эмитента по Облигациям не предусматривается.

12. ИНЫЕ СВЕДЕНИЯ

12.1. Решение о ключевых условиях.

Запрещается начинать размещение структурных облигаций, в соответствии с решением о выпуске которых отдельные условия выпуска структурных облигаций устанавливаются уполномоченным органом управления эмитента до начала размещения структурных облигаций, ранее даты раскрытия (предоставления) эмитентом информации об указанных условиях, а также ранее даты представления в регистрирующий орган уведомления о содержании решения уполномоченного органа эмитента о выпуске структурных облигаций.

В Решении о ключевых условиях Эмитент обязан указать следующую информацию:

- 1) срок погашения Облигаций или порядок его определения;
- 2) информацию, предусмотренную п.5.3.1.3 Решения о выпуске;
- 3) информацию о размере фиксированного купонного дохода (п.5.4.1 Решения о выпуске);
- 4) информацию, касающуюся Дополнительного дохода (п.5.4.2 Решения о выпуске);
- 5) информацию о применении условий о Потенциальных событиях корректировки и/или Событиях корректировки для целей п.5.3.1.5 Решения о выпуске или информация о том, что для целей п.5.3.1.5 Решения о выпуске условия о Потенциальных событиях корректировки и/или Событиях корректировки не применяются.

В Решении о ключевых условиях может быть указана информация о том, что наступление Потенциальных событий корректировки и/или Событий корректировки влечет применение расчетным агентом исполнительных процедур. Исполнительные процедуры, применяемые при наступлении Потенциальных событий корректировки и/или Событий корректировки, указаны в п.3 Приложения 1 к Решению о выпуске.

Решение о ключевых условиях может содержать одновременно:

- (i) перечень Потенциальных событий корректировки (из указанных в п.1.1 Приложения 1 к Решению о выпуске) и/или Событий корректировки (из указанных в п.2.1 Приложения 1 к Решению о выпуске), наступление которых влечет те же последствия, что наступление барьерного события, а также
- (ii) перечень Потенциальных событий корректировки (из указанных в п.1.1 Приложения 1 к Решению о выпуске) и/или Событий корректировки (из указанных в п.2.1 Приложения 1 к Решению о выпуске), наступление которых влечет применение исполнительных процедур.

При этом одно и то же Потенциальное событие корректировки/Событие корректировки не может одновременно содержаться в перечне, указанном в параграфе (i) выше и в перечне, указанном в параграфе (ii) выше;

- 6) информацию о порядке замены ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, после даты начала размещения Облигаций или информацию о том, что Решением о ключевых условиях не предусматривается порядок замены ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, после даты начала размещения Облигаций.

6.1) Если порядок замены ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, после даты начала размещения Облигаций предусмотрен в Решении о ключевых условиях.

Замена ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, после даты начала размещения Облигаций осуществляется по решению расчетного агента.

Указанное решение должно содержать информацию о заменяемой ценной бумаге, входящей в корзину ценных бумаг, заменяющей ценной бумаге, подлежащей включению в корзину ценных бумаг, информацию о цене/порядке определения цены заменяющей ценной бумаги, подлежащей включению в корзину ценных бумаг, на дату фиксации и иные условия, касающиеся замены ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг.

В Решении о ключевых условиях указываются случаи, при которых расчетный агент вправе принять решение о замене ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, критерии заменяющей ценной бумаги, подлежащей включению в корзину ценных бумаг, цену/порядок определения цены заменяющей ценной бумаги, подлежащей включению в корзину ценных бумаг, на дату фиксации и иные условия, касающиеся замены ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг.

Случаи, при наступлении которых расчетный агент вправе принять решение о замене ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, должны быть определены таким образом, чтобы их наступление не зависело от усмотрения Эмитента.

Условия осуществления замены ценной бумаги, входящей в корзину ценных бумаг, в том числе цена/порядок определения цены заменяющей ценной бумаги, подлежащей включению в корзину ценных бумаг, на дату фиксации, определяются расчетным агентом и не должны зависеть от усмотрения Эмитента.

6.2) Если порядок замены ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, после даты начала размещения Облигаций не предусмотрен в Решении о ключевых условиях.

В Решение о ключевых условиях указывается, что:

- а) порядок замены ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, Решением о ключевых условиях не предусматривается;
 - б) замена ценных бумаг, входящих в корзину ценных бумаг, после даты начала размещения Облигаций осуществляется в порядке, установленном пунктом 2 статьи 24¹ Закона о РЦБ.
- 7) информацию о назначении расчетного агента (в том числе полное фирменное наименование (наименование); сокращенное фирменное наименование; ОГРН и иные идентификационные признаки) и его функционале⁵;
- 8) иную информацию в соответствии с Решением о выпуске.

В Решение о ключевых условиях по усмотрению Эмитента может включаться иная информация, в том числе информация о решении Эмитента создавать или не создавать резервный фонд, а также о размере такого фонда при его создании.

Допускается принятие Эмитентом нескольких отдельных решений по вопросам, которые должны быть определены в Решении о ключевых условиях. В таком случае Решение о ключевых условиях представляет собой совокупность взаимосвязанных решений, принятых Эмитентом. Такие решения могут приниматься в любой день (любые дни) в период с даты регистрации выпуска Облигаций и до второго рабочего дня, непосредственно предшествующего дате начала размещения Облигаций.

Эмитент обязан не позднее одного рабочего дня до даты начала размещения Облигаций представить в Банк России уведомление о содержании решения уполномоченного органа Эмитента о выпуске структурных облигаций, содержащее условия отдельных условий выпуска структурных облигаций.

12.1.1. Публикация решения о ключевых условиях.

⁵ В том числе описание порядка, каким образом указанное лицо участвует в определении цены ценных бумаг, включенных в корзину ценных бумаг, цены Контрольной ценной бумаги в контрольную дату, в определении размера выплат в пользу владельцев Облигаций. Расчетный агент должен являться независимым от Эмитента лицом. Если решения, принимаемые лицом, определяются (могут определяться) Эмитентом, то такое лицо не может быть назначено Расчетным агентом.

Решение о ключевых условиях публикуется Эмитентом в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет

- не позднее рабочего дня, непосредственно предшествующего дате начала размещения Облигаций;
- не позднее рабочего дня, непосредственно предшествующего дате начала срока для направления оферт с предложением заключить предварительные договоры купли-продажи Облигаций, если порядок размещения Облигаций предусматривает заключение предварительных договоров купли-продажи Облигаций.

Копия Решения о ключевых условиях направляется в НРД не позднее даты его публикации.

12.1.2. Внесение изменений в решение о ключевых условиях.

Эмитент вправе внести изменения в Решение о ключевых условиях⁶ путем опубликования изменений в такое решение в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет. Такая публикация должна быть осуществлена не позднее предельного срока публикации Решения о ключевых условиях, определенного в соответствии с п.12.1.1 Решения о выпуске.

Копия изменений в Решение о ключевых условиях направляется в НРД не позднее даты его публикации.

В случае внесения Эмитентом изменений в Решение о ключевых условиях после направления Эмитентом в Банк России уведомления о содержании решения уполномоченного органа Эмитента о выпуске структурных облигаций, Эмитент обязан повторно предоставить в Банк России актуализированное уведомление о содержании решения уполномоченного органа Эмитента о выпуске структурных облигаций.

Актуализированное уведомление о содержании решения уполномоченного органа Эмитента о выпуске структурных облигаций направляется в Банк России не позднее рабочего дня, непосредственно предшествующего дате начала размещения Облигаций.

12.2. Сведения об обращении облигаций.

Законодательством Российской Федерации, нормативными актами Биржи, регистрирующего органа, иной инфраструктурной организации или личным законом иностранного лица может быть ограничена возможность реализации прав в отношении Облигаций, включая возможность совершения сделок с Облигациями как на биржевом, так и на внебиржевом рынке, возможность получения выплат по Облигациям или распоряжения такими выплатами. Например, в соответствии с подпунктом б) пункта 1 Указа № 81 сделки (операции), предусмотренные подпунктом «а» пункта 1 Указа № 81 могут осуществляться (исполняться) на основании разрешений, выдаваемых Правительственной комиссией по контролю за осуществлением иностранных инвестиций в Российской Федерации и при необходимости содержащих условия осуществления (исполнения) таких сделок (операций). Согласно подпункту г) пункта 1 Указа № 81 сделки (операции), влекущие за собой возникновение права собственности на ценные бумаги и недвижимое имущество, осуществляемые (исполняемые) с лицами иностранных государств, совершающих недружественные действия, могут осуществляться на организованных торгах на основании разрешений, выдаваемых Центральным банком Российской Федерации по согласованию с Министерством финансов Российской Федерации и содержащих условия осуществления (исполнения) таких сделок (операций).

Если в нормативно-правовые акты, регулирующие отношения, касающиеся Облигаций, прав и обязанностей владельцев Облигаций, будут внесены изменения и действие таких изменений будет распространяться на эти отношения или на права и обязанности владельцев Облигаций, то правила, предусмотренные Решением о выпуске, применяются с учетом указанных изменений.

Если в Решении о выпуске упоминается то или иное лицо, имеется в виду данное лицо, вне зависимости от возможных изменений его наименования (фирменного наименования), или его правопреемник(и).

12.3. Выплата денежных средств по облигациям в российских рублях в связи с наступлением События выплаты в альтернативной валюте.

⁶ в том числе в части сведений, указанных в п. 5.3.1.3. Решения о выпуске облигаций (включая информацию о ценных бумагах, изменение цен на которые является обстоятельством, от наступления или ненаступления которого зависит осуществление выплат по Облигациям)

Если до даты осуществления выплаты по Облигациям имеет место Событие выплаты в альтернативной валюте, как оно определено в Решении о выпуске для соответствующей даты выплаты по Облигациям, Эмитент вправе осуществить такую выплату в российских рублях по официальному курсу китайского юаня к российскому рублю, установленному Банком России и действующему по состоянию на рабочий день, предшествующий соответствующей дате осуществления денежных выплат по Облигациям в соответствии с Решением о выпуске. При этом величина выплаты определяется с точностью до одной копейки (округление цифр при расчете производится по правилам математического округления). Эмитент не несет ответственности за Событие выплаты в альтернативной валюте и связанные с ним последствия.

Получатели выплат по Облигациям, включая НРД, иных депозитариев, осуществляющих учет прав на Облигации, владельцев Облигаций, иных лиц, осуществляющих в соответствии с федеральными законами права по Облигациям, должны обеспечить возможность получения выплат в валюте, в которой такие выплаты фактически осуществляются, в том числе открыть необходимые для этого счета, на которые возможно осуществить зачисление таких выплат в порядке, предусмотренном Решением о выпуске. В ином случае, Эмитент не считается просрочившим исполнение обязательства по осуществлению выплат по Облигациям и в силу ст. 406 ГК РФ не несет ответственности за осуществление такой выплаты. В указанном случае Эмитент также освобождается от субсидиарной ответственности перед депонентами НРД за осуществление таких выплат Облигациям.

Получатели выплат по Облигациям самостоятельно оценивают и несут риски невозможности получения выплат по Облигациям и осуществления операций по Облигациям в связи с обстоятельствами, которые не зависят от Эмитента. К таким рискам относятся, в частности риски того, что

- для кредитной организации, в которой получателю выплат по Облигациям открыт банковский счет в валюте, в которой производятся выплаты по Облигациям, или для кредитной организации, по корреспондентскому счету которой должны быть осуществлены операции для получения выплат по Облигациям, может быть установлен запрет участвовать в переводе денежных средств, предназначенных для указанных выплат по Облигациям, или может отсутствовать возможность участия в таком переводе денежных средств по иным причинам;
- для депозитария, в котором открыт счет депо, предназначенный для учета прав на Облигации, или для депозитария, по счету депо которого должна быть осуществлена операция с Облигациями, может быть установлен любой из следующих запретов: осуществлять операции с Облигациями, учитывать права на Облигации, содействовать в реализации прав по Облигациям или участвовать в получении дохода по Облигации, или может отсутствовать возможность осуществления любого из перечисленных действий по иным причинам.

Эмитент не несет ответственности за реализацию указанных рисков.

О намерении осуществить выплату по Облигациям в российских рублях Эмитент уведомляет НРД в сроки, согласованные с НРД, но в любом случае не позднее окончания рабочего дня, предшествующего дате выплаты по Облигациям, с учетом режима рабочего времени в НРД.

Информация о том, что выплата будет осуществлена Эмитентом в российских рублях, раскрывается Эмитентом в Ленте новостей и на Странице в сети Интернет в дату уведомления НРД, но в любом случае не позднее окончания рабочего дня, предшествующего дате выплаты по Облигациям.

Для целей Приложения 1 к Решению о выпуске вводятся следующие термины:

«**Акция**», под которым понимается любая из следующих ценных бумаг, входящая в корзину ценных бумаг (пп. (А) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске), и при этом являющаяся:

- акцией российского акционерного общества;
- ценной бумагой иностранного эмитента и квалифицированной в качестве акции в соответствии с законодательством Российской Федерации;
- ценной бумагой иностранного эмитента, удостоверяющей права в отношении акции российского акционерного общества или в отношении ценной бумаги иностранного эмитента (далее для целей Приложения 1 к Решению о выпуске – «**депозитарная расписка**»).

«**Базовая акция**», под которым понимается ценная бумага, являющаяся представляемой ценной бумагой по депозитарной расписке, являющейся Акцией.

1. ПОТЕНЦИАЛЬНОЕ СОБЫТИЕ КОРРЕКТИРОВКИ.

1.1. Потенциальным событием корректировки является любое из следующих событий:

- I. дробление, консолидация или конвертация Акции или Базовой акции (кроме случаев, когда это происходит в результате Поглощения по публичной оферте⁷ или Приобретения по публичной оферте⁸) либо безвозмездное распределение Акции, в том числе в форме дивиденда, владельцам Акции эмитента Акции;
- II. распределение, выпуск или выплата в форме дивиденда эмитентом Акции текущим владельцам Акции:
 - а) Акции;
 - б) других акций или иных ценных бумаг, предоставляющих право на получение дивидендов от эмитента Акции;
 - в) акций или иных ценных бумаг другого эмитента, приобретенных (прямо или косвенно) эмитентом Акции в результате выделения или аналогичной сделки;
 - г) любых других ценных бумаг или иного имущества, в каждом случае за плату или иное встречное предоставление, меньшее чем преобладающая рыночная цена, определенная расчетным агентом;
- III. приобретение Акции их эмитентом, его дочерним или зависимым обществом, в т.ч. не полностью оплаченных Акции;
- IV. выпуск эмитентом Акции опционов, в соответствии с которыми цена размещения Акции во исполнение требований по опционам эмитента Акции ниже их рыночной стоимости, определенной расчетным агентом;
- V. распределение в отношении Базовых акций имущества, кроме денежных средств, акций или прав, относящихся к любым Базовым акциям, держателю Базовых акций;
- VI. если в результате какого-либо события (в том числе в результате какого-либо враждебного поглощения эмитента Базовых акций) у держателей Базовых акций снижается объем прав либо голосов по Базовым акциям, и они заключили между собой соглашение, которое предполагает дополнительную эмиссию акций эмитента Базовых акций по цене ниже рыночной, в целях восполнения их утраченных прав по Базовым акциям;
- VII. любое иное событие, которое может повлиять на оценку стоимости Акции вследствие увеличения или уменьшения доли в уставном капитале эмитента Акции, приходящейся на каждую Ацию.

⁷ п.2.1 Приложения 1 к Решению о выпуске.

⁸ п.2.1 Приложения 1 к Решению о выпуске.

1.2. Порядок подтверждения наступления Потенциального события корректировки.

Наступление Потенциального события корректировки определяет (подтверждает) расчетный агент.

Расчетный агент определяет наступление Потенциального события корректировки в отношении каждой из Акций.

Последствия наступления Потенциального события корректировки применяются к той Акции, в отношении которой расчетным агентом определено наступление Потенциального события корректировки.

Расчетный агент уведомляет Эмитента о наступлении Потенциального события корректировки не позднее дня наступления Потенциального события корректировки. Эмитент публикует информацию о наступлении Потенциального события корректировки не позднее следующего рабочего дня с даты получения от расчетного агента уведомления о наступлении Потенциального события корректировки. Публикация осуществляется в Ленте новостей и на странице в сети Интернет.

2. СОБЫТИЕ КОРРЕКТИРОВКИ.

2.1 Событием корректировки является любое из следующих событий:

I. Национализация и Делистинг.

Национализация означает, что Акции или все либо существенная часть имущества эмитента Акции национализирована, реквизирована, конфискована или по иным основаниям подлежит обращению в государственную собственность.

Делистинг означает сообщение биржи расчета⁹, о том, что данная Акция исключается или подлежит исключению биржей расчета из списков ценных бумаг, допущенных к организованным торгам на данной бирже расчета, или сообщение о том, что организованные торги Акцией на этой бирже расчета прекращаются или подлежат прекращению по любому основанию (кроме Поглощения по публичной оферте и Приобретения по публичной оферте).

II. Поглощение по публичной оферте либо Приобретение по публичной оферте.

Поглощение по публичной оферте означает любое из следующих событий:

- а) конвертация или обмен Акции эмитента Акции, в результате чего происходит передача или возникает обязанность передать все Акции, находящиеся в обращении, третьему лицу или лицам;
- б) присоединение эмитента Акции к другому юридическому лицу или слияние эмитента Акции с одним или более юридическими лицами;
- в) требование о выкупе, добровольное или обязательное предложение, уведомление о праве требовать выкупа, иное предложение или действие лица, направленное на покупку или приобретение иным образом 100 процентов находящихся в обращении Акции эмитента Акции, в результате которого происходит передача или возникает обязанность передать такому лицу все указанные Акции (кроме Акции, принадлежащих такому лицу напрямую или контролируемых им через третьих лиц).

Приобретение по публичной оферте означает требование о выкупе, добровольное или обязательное предложение, уведомление о праве требовать выкупа, иное предложение или действие лица, в результате которого это лицо покупает, иным образом приобретает или получает право на приобретение путем конвертации или иным способом более 10 процентов, но менее 100 процентов находящихся в обращении голосующих Акции эмитента Акции.

Поглощение по публичной оферте или Приобретение по публичной оферте устанавливается в соответствии с заключением расчетного агента, сделанным на основе сведений, раскрываемых в уведомлениях государственным органам или саморегулируемым организациям, либо иной информации, которую расчетный агент посчитает имеющей значение.

⁹ определенной для соответствующей Акции в соответствии с пп. (Г) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске.

III. Неликвидность

Под неликвидностью понимается разница между наименьшей ценой заявки на продажу и наибольшей ценой заявки на покупку Акций эмитента. Акций составляет более 1%.

IV. Несостоятельность эмитента Акций, как добровольная, так и принудительная, которая признана в соответствии с применимым законодательством.

Под Несостоятельностью понимается:

- а) эмитент Акций ликвидируется (за исключением ликвидации в результате слияния, присоединения или передачи имущественного комплекса, включая разделение или выделение юридического лица);
- б) эмитент Акций становится несостоятельным или неспособным удовлетворить требования кредиторов по денежным обязательствам или не исполняет их, или признает в рамках судебного, надзорного или административного производства или в порядке обязательного раскрытия информации свою неспособность в полном объеме удовлетворять требования кредиторов по денежным обязательствам и (или) исполнить обязанность по уплате обязательных платежей;
- в) эмитент Акций передает все свое имущество в доверительную собственность (владение, управление) третьему лицу в интересах всех кредиторов в целях получения доходов от имущества и его реализации для последующего распределения полученных денежных средств среди всех кредиторов или заключает мировое соглашение со всеми кредиторами о передаче имущества в погашение требований всех кредиторов;
- г) эмитент Акций инициирует возбуждение производства с целью признания его в судебном порядке несостоятельным или банкротом или применения какой-либо процедуры или средства правовой защиты, предусмотренной применимым законодательством о несостоятельности (банкротстве) или иным аналогичным законодательством, затрагивающим права кредиторов, или становится объектом такого производства, инициированного в отношении него третьим лицом, или подается ходатайство или иск о его ликвидации или прекращении деятельности и продаже имущества для целей удовлетворения требований всех кредиторов и такое производство, ходатайство или иск (за исключением инициированных или поданных самим эмитентом Акций) (i) приводит к признанию его несостоятельным или банкротом, или применению процедуры банкротства, или средства правовой защиты, или принятию решения о его ликвидации, или прекращении его деятельности и продаже имущества для целей удовлетворения требований всех кредиторов или (ii) не прекращено, не отменено, приостановлено или в нем не было отказано в течение тридцати дней после возбуждения или подачи;
- д) принимается резолюция (решение) о ликвидации эмитента Акций, внешнем управлении или прекращении его деятельности и продаже имущества для целей удовлетворения требований всех кредиторов (за исключением ликвидации в результате слияния, присоединения или передачи имущественного комплекса юридического лица, в том числе в виде разделения или выделения);
- е) назначается (или эмитент Акций ходатайствует о таком назначении) внешний или конкурсный управляющий, ликвидатор эмитента Акций, доверительный собственник или иное аналогичное лицо с полномочиями по управлению и распоряжению имуществом эмитента Акций.

V. если в качестве Акций выступают депозитарные расписки:

- а) эмитент Акций дал депозитарию, в котором учитываются Базовые акции, письменные инструкции о снятии с учета или переводе/передаче Базовых акций;
- б) расторжение депозитарного соглашения в отношении Базовых акций;
- в) наступление конверсионного события, под которым понимается любое событие, которое по определению и наблюдению расчетного агента приводит (или может потенциально привести) к конвертации Акций в Базовые акции или любые другие ценные бумаги эмитента Базовых акций, или иное имущество.

2.2. Порядок подтверждения наступления События корректировки.

Наступление События корректировки определяет (подтверждает) расчетный агент.

Расчетный агент определяет наступление События корректировки в отношении каждой из Акций.

Последствия наступления Потенциального события корректировки применяются к той Акции, в отношении которой расчетным агентом определено наступление События корректировки.

Расчетный агент уведомляет Эмитента о наступлении События корректировки не позднее дня наступления События корректировки. Эмитент публикует информацию о наступлении События корректировки не позднее следующего рабочего дня с даты получения от расчетного агента уведомления о наступлении События корректировки. Публикация осуществляется в Ленте новостей и на странице в сети Интернет.

3. ВОСПОЛНИТЕЛЬНЫЕ ПРОЦЕДУРЫ, ПРИМЕНЯЕМЫЕ В СЛУЧАЕ НАСТУПЛЕНИЯ СОБЫТИЯ КОРРЕКТИРОВКИ/ПОТЕНЦИАЛЬНОГО СОБЫТИЯ КОРРЕКТИРОВКИ.

Если в соответствии с Решением о ключевых условиях

- наступление Потенциального события корректировки или События корректировки влечет применение восполнительных процедур и
- такое Событие корректировки или Потенциальное событие корректировки в связи с его наступлением влияет на оценку стоимости Акции по заключению расчетного агента,

то расчетный агент определяет (рассчитывает) значение цены Акции на контрольную дату/дату фиксации и корректирует ее (осуществляет корректировку) с учетом влияния указанного Потенциального события корректировки или События корректировки на оценку стоимости Акции либо, действуя разумно и добросовестно, самостоятельно определяет значение цены Акции на соответствующую контрольную дату/дату фиксации.

В случае дробления, консолидации или конвертации Акции значение цены Акции может быть умножено на коэффициент N, который определяется следующим образом:

- коэффициент N для соответствующей Акции, в отношении которой произошло дробление, консолидация или конвертация Акции рассчитывается как отношение общего количества размещенных Акции непосредственно после корпоративного действия в виде дробления, консолидации или конвертации Акции к общему количеству размещенных Акции по состоянию на дату начала размещения Облигаций.

При этом изменения волатильности, ожидаемых дивидендов, ставки РЕПО или ликвидности, имеющие отношение к Акции, не могут быть единственным основанием для корректировки цены Акции.

Если по заключению расчетного агента Событие корректировки или Потенциальное события корректировки окажет влияние на цену Акции в будущем, расчетный агент определяет дату или даты вступления в силу скорректированного значения цены Акции (данное действие не оказывает влияния на значения цены Акции за предшествующие даты).

Расчетный агент при осуществлении необходимых корректировок (или при самостоятельном определении значения цены Акции на контрольную дату/дату фиксации) может принять во внимание корректировки, внесенные биржей расчета, определенной для соответствующей Акции, в условия торгуемых на ней опционов на Акции применительно к Событию корректировки или Потенциальному событию корректировки.

Корректировка должна быть осуществлена расчетным агентом в течение 10 (Десяти) дней с контрольной даты/даты фиксации, но в любом случае не позднее 3 (Трех) рабочих дней до очередной даты выплаты по Облигациям.

Эмитент публикует информацию о цене Акции на контрольную дату/дату фиксации, скорректированную расчетным агентом или определенную расчетным агентом самостоятельно с соблюдением требований разумности и добросовестности, не позднее следующего рабочего дня с даты получения от расчетного агента уведомления об осуществлении корректировки/определении цены Акции на контрольную дату/дату фиксации. Публикация осуществляется в Ленте новостей и на странице в сети Интернет.

4 СОБЫТИЯ НАРУШЕНИЯ РАСЧЕТА.

4.1. Событие нарушения расчета означает наступление на контрольную дату/дату фиксации любого из указанных ниже обстоятельств при условии, что в каждый из 10 (Десяти) Плановых торговых дней подряд, непосредственно предшествующих такой контрольной дате/дате фиксации, любое из указанных ниже обстоятельств имело место в отношении соответствующей биржи расчета¹⁰.

I. Сбой в проведении торгов;

Сбой в проведении торгов означает любое приостановление или ограничение торгов:

- а) Акцией на определенной для такой Акции бирже расчета;
- б) фьючерсными, опционными или иными срочными договорами (контрактами), базовым активом которых является цена Акции на определенной для такой Акции бирже расчета,

вводимое определенной для такой Акции биржей расчета или иным образом по причине изменения цен, превышающего лимиты, установленные определенной для такой Акции биржей расчета, либо по другой причине.

При этом сбой в проведении торгов является Событием нарушения расчета, если он происходит не ранее одного часа до наступления времени определения значения применимой цены (включая время, когда фиксируется максимальная и/или минимальная цена Акции) и/или закрытия соответствующего Планового торгового дня, являющегося контрольной датой/датой фиксации, и является по заключению Расчетного агента существенным.

II. Сбой в работе биржи расчета;

Сбой в работе биржи расчета означает любое из следующих обстоятельств:

- а) наступление любого события, не являющегося Внеплановым закрытием, которое по заключению Расчетного агента нарушает или затрудняет возможность участников рынка в целом:
 - i) заключать сделки (или получать данные о котировках) с Акциями на определенной для такой Акции бирже расчета;
 - ii) заключать сделки (или получать данные о котировках) с фьючерсными, опционными или иными срочными договорами (контрактами), базовым активом которых является Акция, на определенной для такой Акции бирже расчета.

При этом сбой в работе биржи расчета в этом случае является Событием нарушения расчета, если он происходит не ранее одного часа до наступления времени определения значения применимой цены (включая время, когда фиксируется максимальная и/или минимальная цена Акции) и/или закрытия соответствующего Планового торгового дня, являющегося контрольной датой/датой фиксации, и является по заключению Расчетного агента существенным.

- б) биржа расчета не открывается для проведения торгов Акцией в режиме основных торгов в Плановый торговый день.

III. Внеплановое закрытие.

Внеплановое закрытие означает закрытие соответствующей биржи расчета в Плановый торговый день до наступления обычного времени закрытия торгов, кроме случаев, когда биржа расчета объявляет о таком досрочном закрытии не менее чем за один час до (в зависимости от того, что наступит раньше):

- а) фактического закрытия торгов в режиме основных торгов на этой бирже расчета в этот Плановый торговый день;
- б) срока завершения подачи заявок для их регистрации в системе биржи расчета в целях их исполнения в этот Плановый торговый день.

4.2. Порядок подтверждения наступления События нарушения расчета.

Наступление События нарушения расчета определяет (подтверждает) расчетный агент.

¹⁰ на определенной в соответствии с пп. (Г) п. 5.3.1.3. Решения о выпуске для соответствующей Акции.

Расчетный агент определяет наступление События нарушения расчета в отношении каждой из Акций.

Последствия наступления События нарушения расчета применяются к той Акции, в отношении которой расчетным агентом определено наступление События нарушения расчета.

Расчетный агент уведомляет Эмитента о наступлении События нарушения расчета не позднее дня наступления События нарушения расчета. Эмитент публикует информацию о наступлении События нарушения расчета не позднее следующего рабочего дня с даты получения от расчетного агента уведомления о наступлении События нарушения расчета. Публикация осуществляется в Ленте новостей и на странице в сети Интернет.

4.3. Восполнительные процедуры, применяемые в случае наступления События нарушения расчета.

В случае наступления События нарушения расчета расчетный агент на следующий рабочий день с контрольной даты/даты фиксации, в которую наступило Событие нарушения расчета, обращается с запросом за информацией о цене Акции к не менее чем четырем ведущим банкам на территории Российской Федерации (далее также – «**Дилеры-ориентиры**»).

Значение цены Акции определяется как среднее арифметическое значений цен Акции, полученных расчетным агентом от Дилеров-ориентиров в течение 9 (Девяти) рабочих дней с даты направления запроса. Если в указанный срок получено одно значение цены Акции, то значение цены Акции определяется равным полученному значению цены Акции. Если в указанный срок не получено ни одно значение цены Акции, то значение цены Акции определяется равным нулю.

В Решении о ключевых условиях Эмитент определяет с учетом положений Решения о выпуске не менее 4 (Четырех) Дилеров-ориентиров. Указание лица в качестве Дилера-ориентира не налагает на соответствующее лицо обязательств по выполнению действий, предусмотренных Решением о выпуске для Дилеров-ориентиров. В качестве Дилера-ориентира Эмитент может выбрать любое лицо, которое отвечает хотя бы одному из следующих критериев:

- Дилер-ориентир должен входить в топ-30 крупнейших банков РФ по активам, и/или
- Дилер-ориентир должен являться членом Национальной ассоциации участников фондового рынка (НАУФОР), и/или
- Дилер-ориентир должен являться членом Международной ассоциации свопов и деривативов, Инк (International Swaps and Derivatives Association, Inc).

В качестве Дилера-ориентира не может быть выбрано лицо, аффилированное с Эмитентом и/или с расчетным агентом.

Если в результате ликвидации Дилера-ориентира или наступления в отношении Дилера-ориентира иного аналогичного события, (далее также – «**Замменяемый Дилер-ориентир**») в результате которого количество Дилеров-ориентиров стало менее четырех, расчетный агент определяет в качестве Дилера-ориентира вместо Замменяемого Дилера-ориентира лицо, отвечающее хотя бы одному из следующих критериев (далее также – «**Замещающий Дилер-ориентир**»):

- Замещающий Дилер-ориентир должен входить в топ-30 крупнейших банков РФ по активам, и/или
- Замещающий Дилер-ориентир должен являться членом Национальной ассоциации участников фондового рынка (НАУФОР), и/или
- Замещающий Дилер-ориентир должен являться членом Международной ассоциации свопов и деривативов, Инк (International Swaps and Derivatives Association, Inc).

В качестве Замещающего Дилера-ориентира не может быть выбрано лицо, аффилированное с Эмитентом и/или с расчетным агентом.

Замещающий Дилер-ориентир определяется расчетным агентом с учетом требований разумности и добросовестности. Расчетный агент уведомляет Эмитента о Замменяемом Дилере-ориентире и о Замещающем Дилере-ориентире не позднее 5 (Пяти) рабочих дней, следующих за датой, когда расчетному агенту стало известно о ликвидации Замменяемого Дилера-ориентира или о наступлении в отношении Замменяемого Дилера-ориентира иного аналогичного события, в результате которого количество Дилеров-ориентиров стало менее четырех.

Эмитент публикует обновленную информацию о перечне Дилеров-ориентиров, включая Замещающих Дилеров-ориентиров, не позднее следующего рабочего дня с даты получения от расчетного агента уведомления. Публикация осуществляется в Ленте новостей и на странице в сети Интернет.

При этом количество определяемых расчетным агентом Дилеров-ориентиров должно быть таким, чтобы в любой момент времени общее количество Дилеров-ориентиров составляло не менее 4 (Четырех).

Расчетный агент уведомляет Эмитента об определенной в результате применения восполнительных процедур, применяемых в случае наступления События нарушения расчета, цене Акции в десятый рабочий день с даты наступления События нарушения расчета. Эмитент публикует информацию об определенной цене Акции не позднее следующего рабочего дня с даты получения от расчетного агента уведомления. Публикация осуществляется в Ленте новостей и на странице в сети Интернет.