

Регистрационный номер выпуска ценных бумаг

4B02-290-01481-B-001P

**ПАО Московская Биржа**

(наименование регистрирующей организации)

## **ДОКУМЕНТ, СОДЕРЖАЩИЙ УСЛОВИЯ РАЗМЕЩЕНИЯ ЦЕННЫХ БУМАГ**

**Публичное акционерное общество «Сбербанк России»**

*биржевые облигации бездокументарные процентные неконвертируемые с централизованным учетом прав серии ИОС\_PRT\_H-CARE\_BSK-5Y-001P-277R, номинальной стоимостью 1 000 (Одна тысяча) рублей каждая, с датой погашения 09 июля 2025 г. в 1826-й день с даты начала размещения биржевых облигаций, размещаемые по открытой подписке в рамках программы биржевых облигаций, имеющей идентификационный номер 401481B001P02E от 21.10.2015*

Место нахождения эмитента (в соответствии с его уставом):

*Российская Федерация, город Москва*

*Главный сейлз-трейдер Департамента глобальных рынков ПАО Сбербанк  
(на основании Доверенности 88-Д от 26 февраля 2020 года)*

---

*П.И. Васильев*

---

Далее в настоящем документе будут использоваться следующие термины:

**Программа, Программа Биржевых облигаций** – программа биржевых облигаций, имеющая идентификационный номер 401481B001P02E от 21.10.2015, в рамках которой размещается настоящий выпуск Биржевых облигаций;

**Решение о выпуске** – Решение о выпуске биржевых облигаций в рамках Программы Биржевых облигаций.

**Условия размещения** – настоящий документ, содержащий условия размещения Биржевых облигаций.

**Биржевая облигация или Биржевая облигация выпуска или Облигация** – биржевая облигация, размещаемая в рамках Программы и в соответствии с Решением о выпуске.

**Выпуск** – настоящий выпуск Биржевых облигаций, размещаемых в рамках Программы, Регистрационный номер выпуска ценных бумаг и дата регистрации 4B02-290-01481-B-001P от 06.07.2020.

**Эмитент** – Публичное акционерное общество «Сбербанк России» (ПАО Сбербанк).

**Иные термины, используемые в настоящем документе, имеют значение, определенное в Программе и Решении о выпуске.**

1. Вид, категория (тип), идентификационные признаки ценных бумаг

Вид ценных бумаг: **биржевые облигации**

Иные идентификационные признаки облигаций выпуска, размещаемых в рамках программы облигаций: **биржевые облигации бездокументарные процентные неконвертируемые с централизованным учетом прав серии ИОС\_PRT\_H-CARE\_BSK-5Y-001P-277R**

2. Количество размещаемых эмиссионных ценных бумаг

**Примерное количество Биржевых облигаций - 1 000 000 штук**

3. Срок размещения ценных бумаг

Дата начала размещения Биржевых облигаций: **09 июля 2020 г.**

Дата окончания размещения Биржевых облигаций:

**Дата окончания размещения Биржевых облигаций и Дата начала размещения Биржевых облигаций совпадают.**

**Выпуск Биржевых облигаций не предполагается размещать траншами.**

4. Порядок приобретения ценных бумаг при их размещении

4.1. Способ размещения ценных бумаг: **открытая подписка.**

4.2. Порядок размещения ценных бумаг

4.2.1. Указываются порядок и условия заключения договоров, направленных на отчуждение ценных бумаг первым владельцам в ходе их размещения (форма и способ заключения договоров, место и дата их заключения, а в случае, если заключение договоров осуществляется посредством подачи и удовлетворения заявок - порядок и способ подачи (направления) заявок, требования к содержанию заявок и срок их рассмотрения, способ и срок направления уведомлений (сообщений) об удовлетворении (об отказе в удовлетворении) заявок).

**Размещение Биржевых облигаций проводится путём заключения сделок купли-продажи по цене размещения Биржевых облигаций, установленной в п. 4.3 настоящего документа (далее – Цена размещения).**

**Сделки при размещении Биржевых облигаций заключаются в Публичном акционерном обществе «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – «Биржа», «Московская Биржа», ПАО Московская Биржа) в Режиме «Размещение: Адресные заявки» путём удовлетворения адресных заявок на покупку Биржевых облигаций, поданных с использованием системы торгов Биржи (далее – Система торгов) в соответствии с правилами проведения торгов в Публичном акционерном обществе «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – «Правила торгов Биржи», «Правила Биржи»).**

**Адресные заявки на покупку Биржевых облигаций и встречные адресные заявки на продажу Биржевых облигаций подаются с использованием Системы торгов в электронном виде, при этом простая письменная форма договора считается соблюденной. Моментом заключения сделки по размещению Биржевых облигаций считается момент ее регистрации в системе торгов ПАО Московская Биржа.**

**Приобретение Биржевых облигаций Эмитента в ходе их размещения не может быть осуществлено за счет Эмитента.**

*В случае если потенциальный покупатель не является участником торгов Биржи (далее – «Участник торгов»), он должен заключить соответствующий договор с любым Участником торгов, и дать ему поручение на приобретение Биржевых облигаций. Потенциальный покупатель Биржевых облигаций, являющийся Участником торгов, действует самостоятельно.*

*Для совершения сделки купли-продажи Биржевых облигаций при их размещении потенциальный покупатель обязан заранее (до даты начала размещения Биржевых облигаций) открыть соответствующий счёт депо в Небанковской кредитной организации акционерном обществе «Национальный расчетный депозитарий» (далее – НРД), осуществляющем централизованный учет прав Биржевых облигаций, или в ином Депозитарии. Порядок и сроки открытия счетов депо определяются положениями регламентов соответствующих депозитариев.*

*Изменение и/или расторжение договоров, заключенных при размещении Биржевых облигаций, осуществляется по основаниям и в порядке, предусмотренном гл. 29 Гражданского кодекса Российской Федерации.*

*Торги проводятся в соответствии с Правилами Биржи, зарегистрированными в установленном порядке и действующими на дату проведения торгов.*

*Размещение Биржевых облигаций будет происходить путем сбора адресных заявок со стороны покупателей на приобретение Биржевых облигаций по фиксированной цене, ставке купонного дохода и значению Параметра, заранее определенных Эмитентом, на организованных торгах Биржи, в порядке и на условиях, описанных в настоящем пункте.*

*Размещение Биржевых облигаций предусматривает адресованное неопределенному кругу лиц приглашение делать предложения (оферты) о приобретении размещаемых ценных бумаг. Адресные заявки со стороны Участников торгов являются офертами Участников торгов на приобретение размещаемых Биржевых облигаций.*

*Ответ о принятии предложений (оферт) о приобретении размещаемых Биржевых облигаций направляется Участникам торгов, определяемым по усмотрению Эмитента из числа Участников торгов, сделавших такие предложения (оферты), путем выставления встречных адресных заявок.*

*В Дату начала размещения Биржевых облигаций Участники торгов, действующие как за свой счет, так и за счет и по поручению потенциальных приобретателей, могут в течение периода подачи заявок на приобретение Биржевых облигаций подавать с использованием Системы торгов адресные заявки на покупку Биржевых облигаций в адрес Андеррайтера.*

*Время и порядок подачи адресных заявок в течение периода подачи заявок на приобретение Биржевых облигаций устанавливается Биржей..*

*Заявка на приобретение Биржевых облигаций, которая выставляется в Дату начала размещения Биржевых облигаций в течение периода подачи заявок на приобретение Биржевых облигаций, должна содержать следующие значимые условия:*

- цена приобретения;*
- количество Биржевых облигаций;*
- код расчетов, используемый при заключении сделки с ценными бумагами, подлежащей включению в клиринговый пул клиринговой организации на условиях многостороннего или простого клиринга, и определяющий, что при совершении сделки проводится процедура контроля обеспечения, а надлежащей датой исполнения сделки с ценными бумагами является дата заключения сделки;*
- прочие параметры в соответствии с Правилами Биржи.*

*В качестве цены приобретения должна быть указана Цена размещения Биржевых облигаций (в процентах от номинальной стоимости Биржевой облигации).*

*В качестве количества Биржевых облигаций должно быть указано максимальное количество Биржевых облигаций, которое потенциальный покупатель обязуется приобрести по определенным до даты начала размещения Цене размещения Биржевых облигаций, ставке купонного дохода на первый купонный период и значению Параметра.*

*При этом денежные средства должны быть зарезервированы на торговых счетах Участников торгов в НРД в сумме, достаточной для полной оплаты Биржевых облигаций, указанных в заявках на приобретение Биржевых облигаций, с учётом всех необходимых комиссионных сборов.*

*Заявки, не соответствующие изложенным выше требованиям, не принимаются.*

*В Дату начала размещения Биржевых облигаций по окончании периода подачи заявок на приобретение Биржевых облигаций, выставленных в Дату начала размещения Биржевых облигаций,*

*ПАО Московская Биржа составляет сводный реестр заявок на покупку Биржевых облигаций (далее – «Сводный реестр заявок») и передает его Андеррайтеру. Сводный реестр заявок содержит все значимые условия каждой заявки – цену приобретения, количество ценных бумаг, дату и время поступления заявки, номер заявки, а также иные реквизиты в соответствии с Правилами Биржи.*

*Андеррайтер обеспечивает Эмитенту доступ к информации, содержащейся в Сводном реестре заявок. На основании анализа Сводного реестра заявок Эмитент по своему усмотрению определяет заявки Участников торгов, которые он намерен акцептовать и количество Биржевых облигаций, которые он намерен акцептовать в отношении заявки Участника торгов (далее – «Акцепт заявок»). Участник торгов, подавший заявку в адрес Андеррайтера, соглашается с тем, что его заявка может быть отклонена, акцептована полностью или в части. После получения Сводного реестра заявок, Эмитент направляет Андеррайтеру поручение об акцепте заявок Участников торгов, на основании которого Андеррайтер заключает сделки, направленные на отчуждение размещаемых Биржевых облигаций их первому владельцу, путем выставления встречных заявок в адрес Участников торгов, подавших заявки, соответствующие требованиям, изложенным выше, и указанных в поручении Эмитента. Адресные заявки на покупку ценных бумаг, не подлежащие удовлетворению, отклоняются Андеррайтером в Системе торгов. Факт отклонения Андеррайтером адресной заявки Участника торгов будет означать, что Эмитентом принято решение об отказе в удовлетворении такой заявки.*

*Отдельные письменные уведомления (сообщения) об удовлетворении (об отказе в удовлетворении) заявок, Участникам торгов не направляются.*

4.2.2. Указывается наличие возможности преимущественного права приобретения размещаемых ценных бумаг, в том числе возможности осуществления преимущественного права приобретения ценных бумаг, предусмотренного статьями 40 и 41 Федерального закона "Об акционерных обществах".

***Преимущественное право приобретения Биржевых облигаций отсутствует***

4.2.3. Указываются лицо, которому эмитент выдает (направляет) распоряжение (поручение), являющееся основанием для внесения приходных записей по лицевым счетам (счетам депо) первых владельцев и (или) номинальных держателей, срок и иные условия направления распоряжения (поручения).

***Внесение приходных записей по лицевым счетам (счетам депо) первых владельцев и (или) номинальных держателей Биржевых облигаций осуществляет***

Полное фирменное наименование: ***Небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий"***

Сокращенное фирменное наименование: ***НКО АО НРД***

Место нахождения: ***Российская Федерация, город Москва***

Почтовый адрес: ***105066, г. Москва, ул. Спартаковская, дом 12***

ИНН: ***7702165310***

Телефон: ***(495) 956-27-89, (495) 956-27-90***

Номер лицензии на осуществление депозитарной деятельности: ***045-12042-000100***

Дата выдачи: ***19.02.2009***

Срок действия: ***без ограничения срока действия***

Лицензирующий орган: ***ФСФР России***

***Срок и иные условия учета прав на Биржевые облигации регулируется Федеральным законом от 22.04.1996 № 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг", а также иными нормативными правовыми актами Российской Федерации и внутренними документами депозитария.***

4.2.4. В случае размещения акционерным обществом акций, ценных бумаг, конвертируемых в акции, и опционов эмитента путем закрытой подписки только среди всех акционеров с предоставлением указанным акционерам возможности приобретения целого числа размещаемых ценных бумаг, пропорционального количеству принадлежащих им акций соответствующей категории (типа), указываются: ***не применимо.***

4.2.5. В случае если ценные бумаги размещаются посредством подписки путем проведения торгов, указываются полное фирменное наименование (для коммерческих организаций) или наименование (для некоммерческих организаций) лица, организующего проведение торгов, его место нахождения и основной государственный регистрационный номер.

Полное фирменное наименование: ***Публичное акционерное общество «Московская Биржа ММВБ-РТС»***

Место нахождения: ***Российская Федерация, г. Москва.***

ОГРН: ***1027739387411***

4.2.6. В случае если эмитент и (или) уполномоченное им лицо намереваются заключать предварительные договоры, содержащие обязанность заключить в будущем основной договор, направленный на отчуждение размещаемых ценных бумаг первому владельцу, или собирать предварительные заявки на приобретение размещаемых ценных бумаг, указывается порядок заключения таких предварительных договоров или порядок подачи и сбора таких предварительных заявок.

*Не намереваются.*

4.2.7. В случае если размещение ценных бумаг осуществляется эмитентом с привлечением брокеров, оказывающих эмитенту услуги по размещению и (или) по организации размещения ценных бумаг (включая консультационные услуги, а также услуги, связанные с приобретением брокером за свой счет размещаемых ценных бумаг), по каждому такому лицу указываются:

полное фирменное наименование, место нахождения, основной государственный регистрационный номер:

**Организацией, которая оказывает Эмитенту услуги по организации размещения Биржевых облигаций («Организатор»), и услуги по размещению Биржевых облигаций («Андеррайтер»), является Акционерное общество «Сбербанк КИБ».**

Полное фирменное наименование: **Акционерное общество «Сбербанк КИБ»**

ОГРН: **1027739007768**

Место нахождения: **Российская Федерация, г. Москва**

основные обязанности данного лица в соответствии с его договором с эмитентом, в том числе:

- **подготовка проектов документации, необходимой для размещения и обращения Биржевых облигаций;**

- **подготовка, организация и проведение маркетинговых и презентационных мероприятий перед размещением Биржевых облигаций;**

- **предоставление консультаций по вопросам, связанным с требованиями действующего законодательства Российской Федерации, предъявляемыми к процедуре выпуска Биржевых облигаций, их размещения, обращения и погашения, в том числе предоставление консультаций при раскрытии информации на этапах процедуры эмиссии ценных бумаг и помощь в подготовке соответствующих информационных сообщений;**

- **удовлетворение заявок на покупку Биржевых облигаций по поручению и за счет Эмитента в соответствии с условиями договора и процедурой, установленной в соответствии с Решением о выпуске и Проспектом;**

- **информирование Эмитента о количестве фактически размещенных Биржевых облигаций, а также о размере полученных от продажи Биржевых облигаций денежных средств;**

- **перечисление денежных средств, получаемых Андеррайтером от приобретателей Биржевых облигаций в счет их оплаты, на расчетный счет Эмитента в соответствии с условиями заключенного договора и поручением Эмитента.**

наличие у такого лица обязанностей по приобретению ценных бумаг, а при наличии такой обязанности - также количество (порядок определения количества) ценных бумаг, которое обязано приобрести указанное лицо, и срок (порядок определения срока), в который (по истечении которого) указанное лицо обязано приобрести такое количество ценных бумаг: **указанная обязанность отсутствует**

наличие у такого лица обязанностей, связанных с поддержанием цен на размещаемые ценные бумаги на определенном уровне в течение определенного срока после завершения их размещения (обязанностей, связанных с оказанием услуг маркет-мейкера), а при наличии такой обязанности - также срок (порядок определения срока), в течение которого указанное лицо обязано оказывать услуги маркет-мейкера: **указанная обязанность отсутствует**

наличие у такого лица права на приобретение дополнительного количества ценных бумаг эмитента из числа размещенных (находящихся в обращении) ценных бумаг эмитента того же вида, категории (типа), что и размещаемые ценные бумаги, которое может быть реализовано или не реализовано в зависимости от результатов размещения ценных бумаг, а при наличии такого права - дополнительное количество (порядок определения количества) ценных бумаг, которое может быть приобретено указанным лицом, и срок (порядок определения срока), в течение которого указанным лицом может быть реализовано право на приобретение дополнительного количества ценных бумаг: **указанное право отсутствует**

размер (порядок определения размера) вознаграждения такого лица, а если вознаграждение (часть вознаграждения) выплачивается указанному лицу за оказание услуг, связанных с поддержанием цен на размещаемые ценные бумаги на определенном уровне в течение определенного срока после завершения их размещения (услуг маркет-мейкера), - также размер (порядок определения размера) такого вознаграждения: **не превышает 1% от номинальной стоимости Биржевых облигаций**

4.2.8. В случае если размещение ценных бумаг предполагается осуществлять за пределами Российской Федерации, в том числе посредством размещения соответствующих иностранных ценных бумаг, указывается данное обстоятельство.

***Размещение Биржевых облигаций не предполагается осуществлять за пределами Российской Федерации.***

4.2.9. В случае если эмитент в соответствии с Федеральным законом "О порядке осуществления иностранных инвестиций в хозяйственные общества, имеющие стратегическое значение для обеспечения обороны страны и безопасности государства" является хозяйственным обществом, имеющим стратегическое значение для обеспечения обороны страны и безопасности государства, указывается данное обстоятельство, а также приводятся основания признания эмитента таким хозяйственным обществом.

***Не применимо***

В случае если заключение договоров, направленных на отчуждение ценных бумаг эмитента, являющегося хозяйственным обществом, имеющим стратегическое значение для обеспечения обороны страны и безопасности государства, первым владельцам в ходе их размещения может потребовать принятия решения о предварительном согласовании указанных договоров в соответствии с Федеральным законом "О порядке осуществления иностранных инвестиций в хозяйственные общества, имеющие стратегическое значение для обеспечения обороны страны и безопасности государства", указывается данное обстоятельство.

***Не применимо***

4.2.10. В случае если приобретение акций кредитной организации или некредитной финансовой организации требует предварительного (последующего) согласия Банка России, указывается, что приобретатель акций должен представить кредитной организации или некредитной финансовой организации - эмитенту документы, подтверждающие получение предварительного (последующего) согласия Банка России на указанное приобретение.

***Не применимо***

Указывается на обязанность представления приобретателем ценных бумаг в кредитную организацию или некредитную финансовую организацию - эмитент документов для осуществления оценки его финансового положения (в случае необходимости осуществления такой оценки).

***Не применимо***

4.2.11. В случае размещения ценных бумаг среди инвесторов, являющихся участниками инвестиционной платформы, указывается наименование (индивидуальное обозначение) инвестиционной платформы, используемой для размещения ценных бумаг, а также полное фирменное наименование, основной государственный регистрационный номер и место нахождения оператора указанной инвестиционной платформы.

***Размещение Биржевых облигаций не осуществляется среди инвесторов, являющихся участниками инвестиционной платформы.***

4.3. Цена (цены) или порядок определения цены размещения ценных бумаг

Указывается цена (цены) или порядок определения цены размещения ценных бумаг либо информация о том, что такие цена или порядок ее определения будут установлены уполномоченным органом управления эмитента не позднее даты начала размещения ценных бумаг.

***Цена размещения Биржевых облигаций устанавливается равной 1 000 (Одной тысяче) рублей за одну Биржевую облигацию, что соответствует 100,00% от номинальной стоимости Биржевой облигации.***

В случае если при размещении ценных бумаг предоставляется преимущественное право приобретения ценных бумаг, дополнительно указывается цена или порядок определения цены размещения ценных бумаг лицам, имеющим такое преимущественное право.

***Преимущественное право приобретения Биржевых облигаций не предоставляется.***

4.4. Порядок осуществления преимущественного права приобретения размещаемых ценных бумаг

***Не применимо.***

4.5. Условия, порядок и срок оплаты ценных бумаг

4.5.1. Указываются способ оплаты размещаемых ценных бумаг (денежными средствами, денежными средствами, включая возможность оплаты размещаемых ценных бумаг путем зачета денежных требований, неденежными средствами).

***Биржевые облигации оплачиваются в соответствии с правилами клиринга Клиринговой организации в денежной форме в безналичном порядке в рублях Российской Федерации.***

4.5.2. В случае оплаты размещаемых ценных бумаг денежными средствами указываются: форма оплаты (наличная или безналичная), полное фирменное наименование кредитных организаций, их места нахождения, банковские реквизиты счетов эмитента, на которые должны перечисляться денежные средства, поступающие в оплату ценных бумаг, полное или сокращенное наименование получателя денежных средств и его идентификационный номер налогоплательщика, адреса пунктов оплаты (в случае наличной формы оплаты за ценные бумаги).

В случае если денежные средства в оплату ценных бумаг должны перечисляться на счета брокеров, оказывающих эмитенту услуги по размещению и (или) организации размещения ценных бумаг, указываются банковские реквизиты счетов таких брокеров либо порядок раскрытия (предоставления) сведений о банковских реквизитах их счетов, а также информация о том, что банковские реквизиты их счетов раскрываются (предоставляются) не позднее даты начала размещения ценных бумаг выпуска (дополнительного выпуска).

Форма оплаты: *безналичная*

Денежные средства, полученные от размещения Биржевых облигаций на Бирже; зачисляются на счет Андеррайтера в НРД.

Реквизиты счета, на который должны перечисляться денежные средства в оплату ценных бумаг выпуска:

Владелец счета: *Акционерное общество «Сбербанк КИБ»*

Сокращенное наименование: *АО «Сбербанк КИБ»*

ИНН: *7710048970*

Номер счета: *30411810600019000033*

Кредитная организация:

Полное фирменное наименование на русском языке: *Небанковская кредитная организация акционерное общество «Национальный расчетный депозитарий».*

Место нахождения: *Российская Федерация, город Москва*

ИНН: *7702165310*

БИК: *044525505*

КПП: *770101001*

К/с: *30105810345250000505*

*Андеррайтер переводит средства, полученные от размещения Биржевых облигаций, на счет Эмитента в срок, установленный договором о выполнении функций агента по размещению ценных бумаг на Бирже.*

4.5.3. В случае оплаты ценных бумаг неденежными средствами указываются имущество, которым могут оплачиваться ценные бумаги выпуска, условия оплаты, включая документы, оформляемые при такой оплате (акты приема-передачи имущества, распоряжение регистратору или депозитарию, осуществляющему учет прав на ценные бумаги, которыми оплачиваются размещаемые ценные бумаги, иное), документы, которыми подтверждается осуществление такой оплаты (выписки из государственных реестров, иное), а также сведения о лице (лицах), привлекаемом для определения рыночной стоимости такого имущества: *Не применимо*

4.5.4. В случае оплаты дополнительных акций, размещаемых посредством закрытой подписки, путем зачета денежных требований к акционерному обществу - эмитенту указывается порядок направления эмитенту заявления (заключения с эмитентом соглашения) о таком зачете. *Не применимо*

4.5.5. Срок оплаты размещаемых ценных бумаг.

*Оплата Биржевых облигаций осуществляется в процессе их размещения на торгах Биржи.*

*Денежные расчеты по сделкам купли-продажи Биржевых облигаций при их размещении осуществляются на условиях «поставка против платежа» через НРД в соответствии с Правилами осуществления клиринговой деятельности Клиринговой организации на рынке ценных бумаг.*

5. Порядок раскрытия эмитентом информации о выпуске (дополнительном выпуске) ценных бумаг

В случае если ценные бумаги выпуска (дополнительного выпуска) размещаются путем открытой подписки и (или) регистрация выпуска (дополнительного выпуска) ценных бумаг сопровождается регистрацией проспекта ценных бумаг, указывается, что эмитент раскрывает информацию о настоящем выпуске (дополнительном выпуске) ценных бумаг в порядке, предусмотренном Федеральным законом "О рынке ценных бумаг".

*Эмитент раскрывает информацию о Выпуске в порядке, предусмотренном Федеральным законом от 22.04.1996 № 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" и Программой.*

По усмотрению эмитента указывается порядок раскрытия информации о настоящем выпуске ценных бумаг, используемый эмитентом дополнительно к порядку раскрытия информации, предусмотренному нормативными актами Банка России. *Не применимо*

В случае если информация о выпуске (дополнительном выпуске) раскрывается путем опубликования в периодическом печатном издании (изданиях), указывается наименование такого издания (изданий). *Не применимо*

В случае если информация раскрывается путем опубликования на странице в сети "Интернет", указывается адрес этой страницы в сети "Интернет". <http://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=3043>, [www.sberbank.com](http://www.sberbank.com)

В случае если эмитент обязан раскрывать информацию в форме отчета эмитента и сообщений о существенных фактах, указывается данное обстоятельство.



**Эмитент обязан раскрывать информацию в форме отчета эмитента и сообщений о существенных фактах.**

6. Сведения о документе, содержащем фактические итоги размещения ценных бумаг, который представляется после завершения размещения ценных бумаг

Указываются сведения о документе, содержащем фактические итоги размещения ценных бумаг, который будет представлен в Банк России после завершения размещения ценных бумаг: отчет об итогах выпуска (дополнительного выпуска) ценных бумаг, или уведомление об итогах выпуска (дополнительного выпуска) ценных бумаг.

**В соответствии с Федеральным законом от 22.04.1996 № 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг", депозитарием, осуществляющим централизованный учет прав на Биржевые облигации, представляется уведомление об итогах выпуска эмиссионных ценных бумаг в Банк России.**

7. Иные сведения

1) Сведения о ставке купонного дохода:

**Процентная ставка купонного дохода по купонному периоду устанавливается в размере 1.0994% годовых, что соответствует величине купонного дохода за купонный период в размере 55 руб. 00 коп. на одну Биржевую облигацию.**

2) Сведения о выплате Дополнительного дохода

**Дополнительный доход является процентным доходом по Биржевым облигациям, определяемым как процент от номинальной стоимости (непогашенной части номинальной стоимости) Биржевой облигации, рассчитываемый исходя из сложившейся стоимости Базового актива.**

**Дополнительный доход выплачивается в дату погашения Облигаций и только в случае, если Дополнительный доход будет больше 0.**

**Базовый актив:** Индекс Цены Динамической Корзины (как этот термин определен ниже), («Индекс Цены ДК»);

**Начальное значение Базового актива:** Значение Базового актива в Дату начала размещения Облигаций, если она является Рабочим днём Базового актива, либо, если Дата начала размещения не является Рабочим днём Базового актива – следующий Рабочий день Базового актива после Даты начала размещения Облигаций, приравненное к 1

**Финальное значение Базового актива:** Значение Базового актива в Дату и Время Финального значения Базового актива

**Дата и Время Финального значения Базового актива**

**Дата:**

а) 3 июля 2025 г., если эта дата является Рабочим днем Базового актива;

б) Если не выполняется условие, определенное пунктом а) настоящего раздела, то следующий Рабочий день Базового актива после Даты Финального значения Базового актива

**Время:** наиболее позднее время закрытия торгов на Биржах Акций и инвестиционных паёв, составляющих Динамическую Корзину.

**Публикация Финального значения Базового актива:**

**Информация об определенном Финальном значении Базового актива раскрывается Эмитентом в форме сообщения:**

- в Ленте новостей;

- на странице в Сети Интернет

**не позднее следующего рабочего дня после Даты определения Финального значения Базового актива Расчетным агентом и не позднее даты, предшествующей Дате погашения Биржевых облигаций.**

### Активы, составляющие Динамическую Корзину

Обыкновенные акции и депозитарные расписки (ранее и далее совместно именуемые также «Акции») следующих эмитентов и инвестиционные паи:

i	Наименование инвестиционного пая или эмитента Акции i	Код Bloomberg / ISIN	Валюта Акции и инвестиционного пая i	1. Биржа Акции и инвестиционного пая i 2. Источник определения Цены Акции или инвестиционного пая i	Доля Акции или инвестиционного пая i в Динамической Корзине
1	Select Sector SPDR Trust HEALTHCARE	XLV UP / US81369Y2090	Доллары США	1. NYSE ARCA 2. <a href="https://www.nyse.com/quote/ARCX:XLV">https://www.nyse.com/quote/ARCX:XLV</a> (значение "Close")	1/5
2	iShares Nasdaq Biotechnology ETF	IBB UQ / US4642875565	Доллары США	1. НАСДАК (NASDAQ) 2. <a href="https://www.nasdaq.com/market-activity/funds-and-etfs/ibb/historical">https://www.nasdaq.com/market-activity/funds-and-etfs/ibb/historical</a> (значение "Close/Last")	1/5
3	iShares Trust U.S. Medical Devices ETF	IHI UP / US4642888105	Доллары США	1. NYSE ARCA 2. <a href="https://www.nyse.com/quote/ARCX:IHI">https://www.nyse.com/quote/ARCX:IHI</a> (значение "Close")	1/5
4	Grifols S.A.	GRFS UQ / US3984384087	Доллары США	1. НАСДАК (NASDAQ) 2. <a href="https://www.nasdaq.com/market-activity/stocks/grfs/historical">https://www.nasdaq.com/market-activity/stocks/grfs/historical</a> (значение "Close/Last")	1/5
5	Bayer A.G.	BAYN GY / DE000BAY0017	Евро	1. Франкфуртская биржа (Deutsche Boerse Xetra) 2. <a href="https://www.boerse-frankfurt.de/equity/bayer-ag">https://www.boerse-frankfurt.de/equity/bayer-ag</a> (Раздел «Price History», значение «Close»)	1/5

**Порядок определения цен Акции и инвестиционных паёв, составляющих Динамическую Корзину:** Цены закрытия каждой Акции и инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, в соответствующей Валюте Акции и инвестиционного пая на соответствующей Бирже Акции и инвестиционных паёв, составляющих Динамическую Корзину, в Рабочий день Базового актива

**Дата Оценки (t):** Каждый Рабочий день Базового Актива, начиная с Даты начала размещения Облигаций (включительно) до Даты определения Финального значения Базового актива (включительно)

**Рабочий день Базового Актива:** Каждый день, когда проводятся торги на всех Биржах Акции и инвестиционных паёв, составляющих Динамическую Корзину

Если в любую Дату Оценки (t) Цена какой-либо Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую корзину, не может быть определена, то для такой Акции или инвестиционного пая её/его Цена определяется на:

а) Следующий после Даты Оценки (t), 2-ой, 3-ий, ..., m-1-ый, m-ый Рабочий день Базового актива после Даты Оценки (t), но не позднее 4-го рабочего дня до Даты погашения Облигаций;

б) Если для такой Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, её/его Цена не может быть определена в соответствии с пунктом а) настоящего раздела, то последовательно: 1-ый, 2-ой, ..., m-1-ый, m-ый Рабочий день Базового актива, предшествующий Дате Оценки (t), соответственно, где m-ый Рабочий день Базового актива, предшествующий Дате Оценки (t), является следующим, после Даты начала размещения Биржевых облигаций, Рабочим днём Базового актива (т.е. последовательно проводится определение Цены такой Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, в указанные даты, до тех пор, пока Цена такой Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, сможет быть определена)

**Условие** – Финальное значение Базового актива одновременно:

а. может быть определено, с учётом процедур, указанных выше, и

б. превышает Начальное значение Базового актива.

**В случае невыполнения Условия Дополнительный доход равен 0 (Нулю).**

<p><b>Индекс Цены Динамической Корзины (t)</b></p>	<p>Означает для Даты Оценки (t) значение, определённое Расчетным агентом по Облигациям в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{Индекс Цены ДК (t)} = \frac{\text{ЗДК}_t}{\text{Начальное Значение ДК}}, \text{ где}$ <p><i>ЗДК<sub>t</sub></i> – Значение Динамической Корзины на соответствующую Дату Оценки (t), в процентах;  <i>Начальное Значение ДК</i> – Значение Динамической Корзины в Дату начала размещения Облигаций, если она является Рабочим днём Базового актива (t=0), либо если Дата начала размещения не является Рабочим днём Базового актива – следующий Рабочий день Базового актива после Даты начала размещения Облигаций, равное 100%</p>
<p><b>Значение Динамической Корзины (t)</b></p>	<p>На каждую Дату Оценки (t), определяется в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{ЗДК}_t = \text{ЗДК}_{t-1} \times \left[ 1 + \text{Exp}_{t-1} \times \left( \frac{\text{Цена ДК}_t}{\text{Цена ДК}_{t-1}} - 1 \right) - \text{Exp}_{t-1} \times \left( \text{Ставка}_{t-1} \times \frac{\text{Факт}_{t,t-1}}{360} \right) \right], \text{ где}$ <p><i>ЗДК<sub>t</sub></i> – Значение Динамической Корзины на Дату Оценки (t);  <i>ЗДК<sub>t-1</sub></i> – Значение Динамической Корзины на Дату Оценки, непосредственно предшествующую Дате Оценки (t);  <i>Цена ДК<sub>t</sub></i> – Цена Динамической Корзины на Дату Оценки (t);  <i>Цена ДК<sub>t-1</sub></i> – Цена Динамической Корзины на Дату Оценки, непосредственно предшествующую Дате Оценки (t);  <i>Exp<sub>t-1</sub></i> – значение Зависимости на Дату Оценки, непосредственно предшествующую Дате Оценки (t);  <i>Дата оценки (t)</i> – Рабочий день Базового актива;  <i>Дата оценки (0)</i> – Дата начала размещения Облигаций;  <i>Факт<sub>t,t-1</sub></i> – количество календарных дней, считая со дня непосредственно предшествующего Дате Оценки (t), включительно, до текущей Даты Оценки (t), исключая её.  <i>Ставка<sub>t-1</sub></i> – значение 3-месячной ставки LIBOR для долларов США, опубликованное на странице информационной системы Bloomberg (код: US0003M) около 11:00 по Лондонскому времени в Дату оценки, непосредственно предшествующую Дате Оценки (t). Если такая ставка не может быть определена или прекратит рассчитываться, Расчетный агент по Облигациям выберет другую страницу в информационных системах Reuters или Bloomberg или рассчитает, действуя в коммерчески разумной манере, значение ставки, используя такие источники, которые он самостоятельно определит в отношении такой даты</p>
<p><b>Зависимость</b></p>	<p>Значение Зависимости на каждую Дату Оценки (t) определяется в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{Exp}_t = \text{Min} \left[ \text{MaxExp}; \left( \frac{\text{Целевая_Волатильность}}{\text{Реализованная_Волатильность}_{t-1}} \right) \right], \text{ где}$ <p><i>Exp<sub>t</sub></i> – Значение Зависимости на Дату Оценки (t);  <i>MaxExp</i> – 120.00%;  <i>Целевая_Волатильность</i> – 9.50%;  <i>Реализованная_Волатильность<sub>t-1</sub></i> – значение Реализованной Волатильности в Дату Оценки, непосредственно предшествующую Дате Оценки (t);  <i>Min [A; B]</i> – означает выбор меньшего из значений A и B</p>

<p><b>Реализованная Волатильность</b></p>	<p>Значение Реализованной Волатильности на любую Дату Оценки (t) определяется в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{Реализованная\_Волатильность}_t = \text{Волатильность}_{t,20}$ <p>Волатильность<sub>t,20</sub> = <math>\sqrt{252} \times</math></p> $\sqrt{\frac{20}{19} \times \left[ \frac{1}{20} \sum_{j=1}^{20} \left( \ln \left( \frac{\text{Цена ДК}_{t-20+j}}{\text{Цена ДК}_{t-20+j-1}} \right) \right)^2 - \left( \frac{1}{20} \sum_{j=1}^{20} \ln \left( \frac{\text{Цена ДК}_{t-20+j}}{\text{Цена ДК}_{t-20+j-1}} \right) \right)^2 \right]}$ , где <p><b>252</b> – фактор аннуализации для целей расчета реализованной волатильности и представляет собой ожидаемое количество Рабочих дней Базового Актива в каждом календарном году;</p> <p><b>ln</b> – натуральный логарифм;</p> <p>При этом результат расчета значения Волатильность<sub>t,20</sub> округляется до 2-х знаков после запятой.</p>
<p><b>Цена Динамической Корзины, Цена ДК</b></p>	<p>Цена Динамической Корзины в любую Дату Оценки (t), рассчитанная в соответствии со следующей формулой:</p> $\text{Цена ДК}_t = \text{Цена ДК}_{t-1} \times \left( 1 + \sum_{i=1}^5 \text{вес}^i \times \text{Изменение цены Акции}_t^i \right), \text{ где}$ $\text{Изменение цены Акции}_t^i = \left( \frac{\text{Акция}_t^i + \text{ДИВ}_t^i}{\text{Акция}_{t-1}^i} - 1 \right), \text{ где}$ <p><b>Цена ДК<sub>0</sub></b> – 100.00%;</p> <p><b>Цена ДК<sub>t-1</sub></b> – Цена ДК на Дату оценки, непосредственно предшествующую Дате Оценки (t);</p> <p><b>Акция<sub>t</sub><sup>i</sup></b> – цена 1 (одной/одного) Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, с порядковым номером i в Дату Оценки (t);</p> <p><b>Акция<sub>t-1</sub><sup>i</sup></b> – цена 1 (одной/одного) Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, с порядковым номером i в Дату Оценки (t-1);</p> <p><b>ДИВ<sub>t</sub><sup>i</sup></b> – означает, для Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, с порядковым номером i в Дату Оценки (t) сумму дивидендов, для которых Дата Отсечки на соответствующей Бирже Акций или инвестиционных паёв, составляющих Динамическую Корзину, приходится на Рабочий день Базового Актива, находящийся в периоде между Датой Оценки, непосредственно предшествующей Дате Оценки (t) (исключая её), до текущей Даты Оценки (t) (включительно), за минусом налога, применимого к доходам полученным в виде дивидендов от российских и иностранных организаций российскими организациями, а также по доходам в виде дивидендов, полученных по акциям, права на которые удостоверены депозитарными расписками, в том числе удерживаемого у источника выплаты и рассчитанного по ставке, применяемой к дивидендам по Акции или инвестиционному паю, составляющим Динамическую Корзину, с порядковым номером i, в случае владения им или ею российской организацией, с учётом применимых положений договоров об избежании двойного налогообложения;</p> <p><b>вес<sup>i</sup></b> – равен, для Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, с порядковым номером i, её/его Доле в Динамической Корзине</p>
<p><b>Дата Отсечки</b></p>	<p>Рабочий день Базового Актива, начиная с которого покупка Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, с порядковым номером i, на соответствующей Бирже Акций или инвестиционных паёв, составляющих Динамическую Корзину, не дает права на получение суммы ранее объявленных дивидендов. Во избежание сомнений, последним Рабочим днём Базового Актива, в который покупка Акции или инвестиционного пая, составляющих Динамическую Корзину, с порядковым номером i дает право на получение суммы ранее объявленных дивидендов, является Рабочий день Базового Актива, непосредственно предшествующий Дате Отсечки</p>

**Порядок определения размера Дополнительного дохода:**

***В случае выполнения Условия Дополнительный доход на одну Биржевую облигацию (в процентах) рассчитывается по следующей формуле:***

$ДД(\%) = P \times (\text{Индекс Цены ДК (фин)} - 1) \times 100\%$ , где

$ДД(\%)$  – размер Дополнительного дохода, в процентах, округлённый до 4 знаков после запятой согласно правилам математического округления;

$P$  - Параметр (как он определен в Программе Биржевых облигаций), равный 0,75;

***Индекс Цены ДК (фин)*** – Финальное значение Базового актива;

***Порядок расчета суммы Дополнительного дохода, подлежащего выплате на одну Биржевую облигацию:***

$ДД(\text{руб.}) = \text{Nom} * ДД(\%)$ , где

$ДД(\%)$  – размер Дополнительного дохода, рассчитанный в порядке, указанном выше, в процентах;

$\text{Nom}$  – номинальная стоимость (непогашенная часть номинальной стоимости) одной Биржевой облигации, в рублях Российской Федерации.

Дополнительный доход в рублях Российской Федерации, подлежащий выплате на одну Биржевую облигацию, рассчитывается с точностью до второго знака после запятой (округление второго знака после запятой производится по правилам математического округления: в случае, если третий знак после запятой больше или равен 5, второй знак после запятой увеличивается на единицу, в случае, если третий знак после запятой меньше 5, второй знак после запятой не изменяется).

***3) Во избежание сомнений, выплата любых доходов в рамках настоящего Выпуска в соответствии с положениями секции 871(m) Налогового Кодекса США не признается эквивалентом дивидендов.***

