

ПАСПОРТ СТРУКТУРНОЙ ОБЛИГАЦИИ с возможностью досрочного автопогашения

Этот документ предназначен для информирования Вас об основных характеристиках такого финансового инструмента как структурная облигация с возможностью досрочного автопогашения, а также связанной с ним структуре расходов, наличии ограничений на досрочный выход из инвестиций и о существенных рисках.

1. Это важно:

- 1.1. Представленная информация не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, а также не является рекламой.
- 1.2. Структурная облигация не является банковским депозитом, связанные с ней риски не подлежат страхованию в соответствии с Федеральным законом от 23 декабря 2003 года № 177-ФЗ «О страховании вкладов в банках Российской Федерации». Возврат инвестиций и доходность вложений в Структурную облигацию не гарантированы государством.
- 1.3. Условия Структурной облигации могут быть трудны для понимания.
- 1.4. Перед приобретением Структурной облигации следует ознакомиться с указанной ниже информацией.

2. Что представляет собой Структурная облигация:

1. Краткая информация о Структурной облигации	
Вид финансового инструмента	Структурные облигации серии 03 документарные на предъявителя с обязательным централизованным хранением, размещаемые путем закрытой подписки, неконвертируемые с залоговым обеспечением процентные структурные с возможностью получения дополнительного дохода и возможностью досрочного погашения, предназначенные для квалифицированных инвесторов
Код государственной регистрации	6-03-00508-R
Код ISIN	RU000A1011M2
Категория инвестора, которой предназначен финансовый инструмент	Только для квалифицированных инвесторов
2. Информация об Эмитенте	
Наименование	ООО «СФО БКС Структурные Ноты» ¹
Контакты	125171, Российская Федерация, г. Москва, Ленинградское шоссе, дом 16А, строение 1, этаж 8, комната 24. Телефон управляющей организации эмитента: +7 (495) 777 00 85.
3. Информация о паспорте Структурной облигации	
Дата разработки паспорта	14.11.2019
Дата последней актуализации паспорта	17.04.2020
4. Информация о разработчике паспорта Структурной облигации	
Наименование	ООО «СФО БКС Структурные Ноты»

¹ Более подробная информация об эмитенте раскрыта в сети «Интернет» в открытом доступе: <http://bcs-sn.ru/about/>

Контакты	Аналогичны указанным в отношении Эмитента
Наименование и контакты регулирующего органа	Центральный Банк Российской Федерации ² Почтовый адрес: 107016, Москва, ул. Неглинная, д. 12, Банк России Телефон: 8 800 300-30-00 (бесплатно для звонков из регионов России)

Структурная облигация – это ценная бумага, по условиям выпуска которой величина дохода, сумма возврата вложенных инвестиций, возможность досрочного погашения зависит от наступления определенных условий, а именно от достижения определенных значений цен Базовых активов в определенные даты.

Структурные облигации предназначены для инвесторов, заинтересованных в повышенной доходности, обусловленной риском частичной потери инвестиций (при отсутствии дефолта (банкротства) Эмитента).

Механизм действия Структурной облигации:

➤ В Дату определения Первоначально зафиксированных условий Эмитентом фиксируются установленные на эту дату цены закрытия Базовых активов на соответствующей бирже, указанной для Базового актива (далее – **Первоначально зафиксированные условия**).

➤ Условия выплаты фиксированного купонного дохода.

Фиксированный купонный доход гарантированно выплачивается Эмитентом за исключением случая наступления Барьерного события. При наступлении Барьерного события выплата фиксированного купонного дохода Эмитентом не осуществляется, в том числе в какой-либо его части.

➤ Условия выплаты дополнительного дохода.

Выплата дополнительного дохода осуществляется Эмитентом, если в Контрольную дату/Дополнительную дату значение каждого Базового актива (значение каждого Базового актива определяется как частное от деления цен Базового актива в Контрольную дату/Дополнительную дату на Первоначально зафиксированные условия по соответствующему Базовому активу умноженному на 100%)) равно или выше 80% от Первоначально зафиксированных условий. В иных случаях выплата дополнительного дохода не осуществляется.

Накопленный, но не выплаченный дополнительный доход будет учитываться при выплате дополнительного дохода за последующие периоды при возникновении у Эмитента обязанности по его выплате в следующую по очереди Контрольную дату или в Дополнительную дату.

➤ Условия и порядок досрочного погашения в случае наступления Барьерного события.

²Более подробная информация размещена на официальном сайте Банка России: <https://www.cbr.ru/contacts/>.

Структурная облигация досрочно погашается, если хотя бы одно из значений Базовых активов (значение каждого Базового актива определяется как частное от деления цен Базового актива в Дату определения Барьерного события на Первоначально зафиксированные условия по соответствующему Базовому активу умноженному на 100%) в Дату определения Барьерного события находится ниже Уровня барьера для Барьерного события. Структурная облигация досрочно погашается с выплатой 85 % от её номинальной стоимости.

➤ Условия и порядок досрочного погашения в случае наступления Бонусного Барьерного события.

Если в Контрольную дату для определения Бонусного Барьерного события значение каждого Базового актива (значение каждого Базового актива определяется как частное от деления цен Базового актива в Контрольную дату определения Бонусного Барьерного события на Первоначально зафиксированные условия по соответствующему Базовому активу умноженному на 100%) равно или выше Уровня Бонусного барьера. Структурная облигация досрочно погашается с выплатой 100 % от её номинальной стоимости.

➤ Условия и порядок погашения Структурной облигации при отсутствии событий её досрочного погашения.

Структурная облигация погашается в Дату погашения с выплатой 100 % от её номинальной стоимости.

➤ Потенциальные события корректировки и События корректировки (как данные термины определены в п. 17 Решения о выпуске Структурной облигации³) в отношении Базового актива отменяют наступление Барьерного события, Бонусного Барьерного события и Расчетный агент применяет восполнительные процедуры как это определено Решением о выпуске Структурной облигации.

➤ Выплаты по Структурной облигации производятся только денежными средствами в валюте РФ в безналичном порядке в Дату платежа.

Ключевые характеристики Структурной облигации	Ключевые даты
<p><u>Базовые активы:</u></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. акция обыкновенная ПАО «Сбербанк России» (ISIN: RU0009029540). 2. Американская депозитарная расписка (ISIN: US69343P1057) эмитента Citibank N.A. на акции обыкновенные ПАО «ЛУКОЙЛ» (ISIN: RU0009024277). 3. акция обыкновенная ПАО «ГМК «Норильский никель» (ISIN: RU0007288411). 4. акция обыкновенная ПАО «Газпром» (ISIN: RU0007661625). 5. акция обыкновенная Yandex N.V. (ISIN: NL0009805522). 	<p><u>Дата выпуска:</u> 14.11.2019</p>

³ <http://bcs-sn.ru/issuing-documents/>

<u>Номинальная стоимость:</u> 1 000 рублей	<u>Дата погашения:</u> 10.11.2022
<u>Валюта выпуска:</u> рубль РФ	<u>Дата определения Первоначально зафиксированных условий:</u> 13.12.2019
<u>Процентная ставка фиксированного купонного дохода:</u> 0,0001% годовых	<u>Контрольные даты для определения дополнительного дохода:</u> 20.04.2020 19.10.2020 19.04.2021 18.10.2021 18.04.2022 <u>Дополнительная дата для определения дополнительного дохода:</u> 17.10.2022
<u>Процентная ставка дополнительного дохода:</u> 8% за период, равный количеству дней между Датой выпуска и Первой Контрольной датой для определения дополнительного дохода / между Первой Контрольной датой для определения дополнительного дохода и следующей за ней Контрольной датой для определения дополнительного дохода / между каждой следующей Контрольной датой для определения дополнительного дохода и последующей за ней Контрольной датой для определения дополнительного дохода / между последней Контрольной датой для определения дополнительного дохода и Дополнительной датой.	<u>Дата определения Барьерного события:</u> 17.10.2022
<u>Барьер для выплаты фиксированного купонного дохода:</u> 80 % <u>Барьер для выплаты дополнительного дохода:</u> 80%	<u>Контрольные даты для определения Бонусного Барьерного события:</u> 20.04.2020 19.10.2020 19.04.2021 18.10.2021 18.04.2022
<u>Уровень барьера, при котором осуществляется досрочное погашение Структурной облигации с выплатой 85 % от её номинальной стоимости (Уровень барьера для Барьерного события):</u> 80% от Первоначально зафиксированных условий	
<u>Уровень Бонусного барьера, при котором осуществляется досрочное погашение Структурной облигации с выплатой 100 % от её номинальной стоимости (Уровень Бонусного барьера):</u> 100% от Первоначально зафиксированных условий	
<u>Даты платежа:</u>	
<ul style="list-style-type: none"> ▪ 10.11.2022 (выплата фиксированного купонного дохода и номинальной стоимости Структурной облигаций при отсутствии события её досрочного погашения); ▪ не позднее, чем на 16-й рабочий день после наступления Контрольной даты, Дополнительной даты либо в Дату погашения (выплата дополнительного дохода при наступлении обстоятельств в соответствующую дату, наступление которых необходимо для возникновения обязанности по его выплате); ▪ не позднее, чем на 16-й рабочий день с даты наступления Барьерного события (выплата 85 % от номинальной стоимости Структурной облигации в связи с наступлением Барьерного события); 	

- не позднее, чем на 16-й рабочий день с даты наступления Бонусного Барьерного события (выплата 100 % от номинальной стоимости Структурной облигации, а также фиксированного купонного дохода (в размере, рассчитанном в соответствии с Решением о выпуске Структурной облигации на дату наступления Бонусного Барьерного события) в связи с наступлением Бонусного Барьерного события)

3. Что произойдет, если эмитент не сможет исполнить свои обязательства

Обеспечением исполнением обязательств эмитента по Структурной облигации является залог прав по договору банковского счета в отношении 10 000 рублей, учитываемых на данном банковском счете.

В случае частичного или полного дефолта (банкротства) Эмитента, инвестор может частично или полностью потерять вложенные инвестиции.

4. Как долго рекомендуется владеть Структурной облигацией, возможен ли досрочный возврат инвестиций

Возможность досрочного погашения по усмотрению Эмитента не предусматривается. Досрочный возврат инвестиций возможен в связи с наступлением Барьерного события, Бонусного Барьерного события или в связи досрочным погашением Эмитентом Структурных облигаций по требованию их владельцев. Досрочный возврат инвестиций осуществляется в размере, порядке и на условиях, указанных для случая наступления Барьерного события, Бонусного Барьерного события или досрочного погашения Эмитентом Структурных облигаций по требованию их владельцев соответственно.

Досрочный возврат инвестиций возможен также в случае продажи Структурной облигации. В этом случае досрочный возврат инвестиций осуществляется в размере, порядке и на условиях, указанных в соответствующем договоре купли-продажи и применимых к нему нормативных актах.

По мнению Эмитента, рекомендуемый период инвестирования – до даты погашения Структурной облигации.

5. Какие риски по мнению Эмитента несет финансовый инструмент

➤ Рыночный риск.

Риск неблагоприятного изменения цен ценных бумаг, оставляющих базовый актив Структурной облигации, в результате чего инвестор может не получить дополнительный доход в ожидаемом размере, а Структурная облигация может быть досрочно погашена в размере 85 % от её номинальной стоимости;

Инвестор должен понимать, что стоимость Структурной облигации может как расти, так и снижаться, и её рост в прошлом не означает её роста в будущем.

➤ Риск ликвидности.

Может быть снижена возможность реализации Структурной облигации по необходимой цене из-за снижения на неё спроса, в связи с чем оперативная продажа Структурной облигации может быть недоступна.

➤ Риск дефолта

В случае неплатежеспособности Эмитента Структурной облигации вероятность её погашения в срок и в полном объеме может быть снижена или недоступна, что приведет к потере части или всех вложенных средств в Структурную облигацию.

6. Какова структура расходов

По общему правилу, Инвестор не несет расходов, связанных с приобретением, владением и продажей Структурной облигации кроме расходов по уплате вознаграждения и иных комиссий⁴, предусмотренных заключенными инвестором договорами на брокерское и депозитарное обслуживание, а также установленной применимым законом обязанности по уплате налоговых платежей. Обязанность по несению иных расходов может вытекать из особенностей применимого к инвестору законодательства.


7. Кому жаловаться

В адрес Эмитента жалобы и обращения необходимо направлять на следующий почтовый адрес: 125171, Российская Федерация, г. Москва, Ленинградское шоссе, дом 16А, строение 1, этаж 8, комната 24.

В адрес Представителя владельцев облигаций (общество с ограниченной ответственностью «Лигал Кэпитал Инвестор Сервисез»):

- на следующий почтовый адрес: 119048, Российская Федерация, г. Москва, улица Усачева, дом 1 строение 1;
- на электронный адрес: info@lcpis.ru.

Достоверность и корректность всей информации, содержащейся в настоящем Паспорте, а также ее соответствие в полном объеме условиям, изложенным в эмиссионной документации по Структурной облигации, подтверждает каждый из ниже перечисленных:

Эмитент Структурной облигации:	
Представитель владельцев Структурной облигации, определенный в Решении о выпуске Структурной облигации:	
Расчетный агент по Структурной облигации, определенный в Решении о выпуске Структурной облигации:	

⁴ Размер вознаграждения и комиссий, которые инвестор обязан уплатить, необходимо уточнять напрямую у брокера и депозитария, с которыми заключены договоры на брокерское и на депозитарное обслуживание.