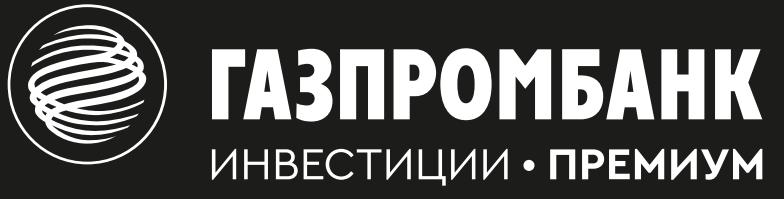


© МАЙ 2024 ГОДА



# Структурная облигация серии 21

! Информация, изложенная в настоящей презентации, адресована лицам, являющимся квалифицированными инвесторами. Если вы не являетесь квалифицированным инвестором, просим вас отказаться от ознакомления с настоящим материалом.  
Распространение, передача, пересылка настоящего материала запрещена.



# Карточка продукта

Базовые активы

Группа ЛСР  
ТГК-1  
М.ВИДЕО  
БАШНЕФТЬ  
РОССЕТИ  
РЕНЕССАНС СТРАХОВАНИЕ

Уровень купонного барьера\*

90%

Процентная ставка  
дополнительного дохода

23% годовых

Дата погашения

28.05.2027

Барьер события\*\*

1%

Периодичность расчета в  
целях выплаты  
дополнительного дохода:

Ежеквартально

Специальный барьер\*\*\*

100%

Дата оценки:

Ежеквартально

Дата фиксации начальной цены:

21.05.2024

Вид финансового инструмента

Структурная облигация

Номинал:

1000 ₽

Эмитент:

ООО «СФО БКС Структурные Ноты»

Тип облигации

Внебиржевая

Валюта выпуска:

Рубль

ISIN:

RU000A107K75

\*Барьер исполнения в отношении дополнительного дохода.

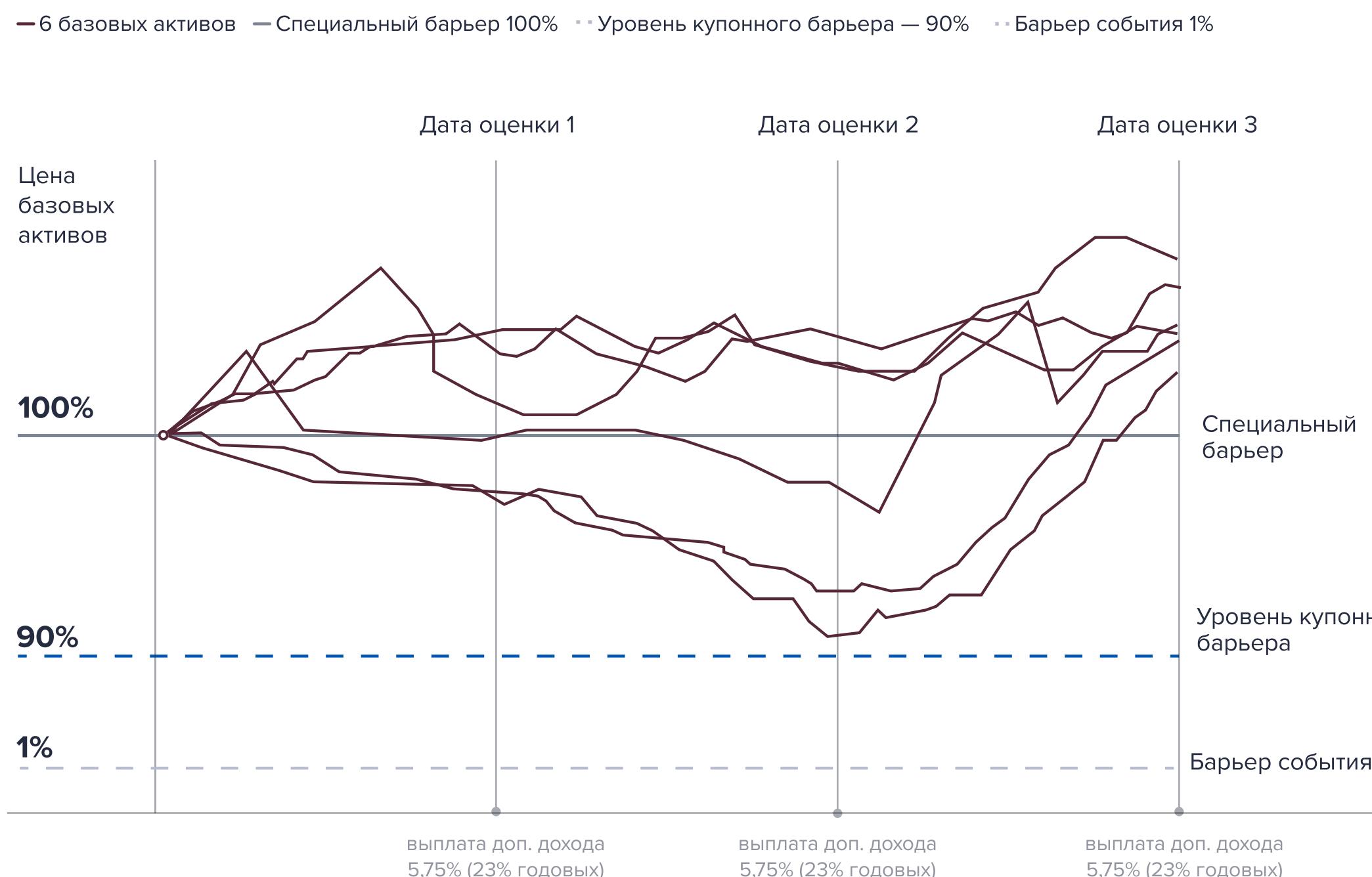
\*\*Барьер, используемый при определении суммы расчета в дату погашения.

\*\*\*Барьер, используемый для поверки условий досрочного погашения.

# Сценарий 1: Досрочное автопогашение

## Описание сценария:

- Условия досрочного погашения в даты оценки 1 и 2 не достигаются, на 3-ю дату оценки цены всех базовых активов оказались выше Специального барьера → Облигация погашается по 100% от номинала.
- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).



## ДАТА ОЦЕНКИ 1

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

## ДАТА ОЦЕНКИ 2

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

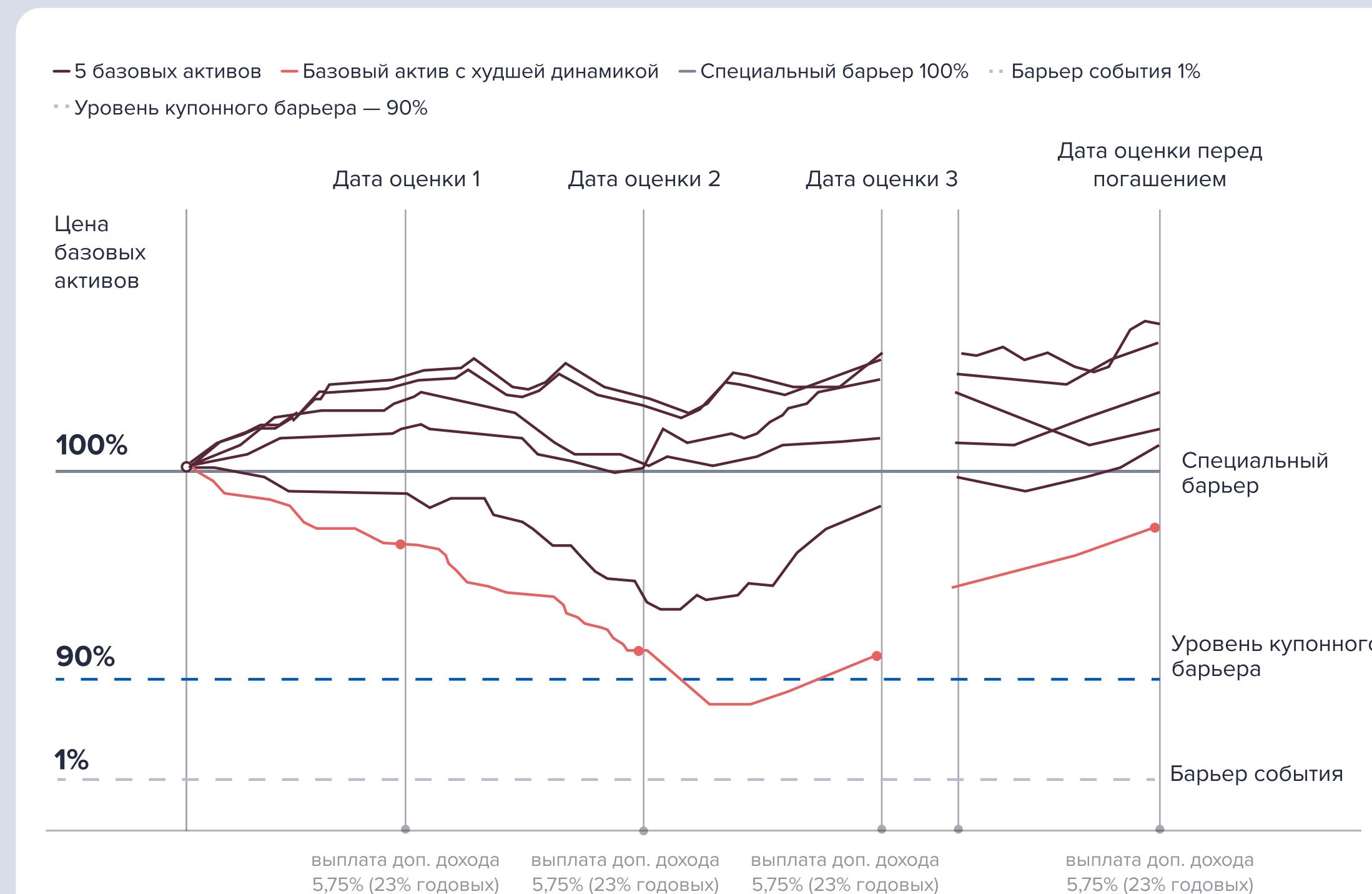
## ДАТА ОЦЕНКИ 3

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цены всех базовых активов выше Специального барьера → Происходит автопогашение облигаций по номинальной стоимости. Инвестору возвращается 100% от номинала.

# Сценарий 2: Погашение по номиналу в дату погашения

## Описание сценария:

- Во все даты оценки цена хотя бы одного из базовых активов находилась ниже Специального барьера.
- Цены всех базовых активов на Дату оценки перед погашением оказались выше Барьера события → Облигации погашаются по номинальной стоимости. Инвестору возвращается 100% от номинала.
- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).



## ДАТА ОЦЕНКИ 1

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

## ДАТА ОЦЕНКИ 2

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

## ДАТА ОЦЕНКИ 3–11

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

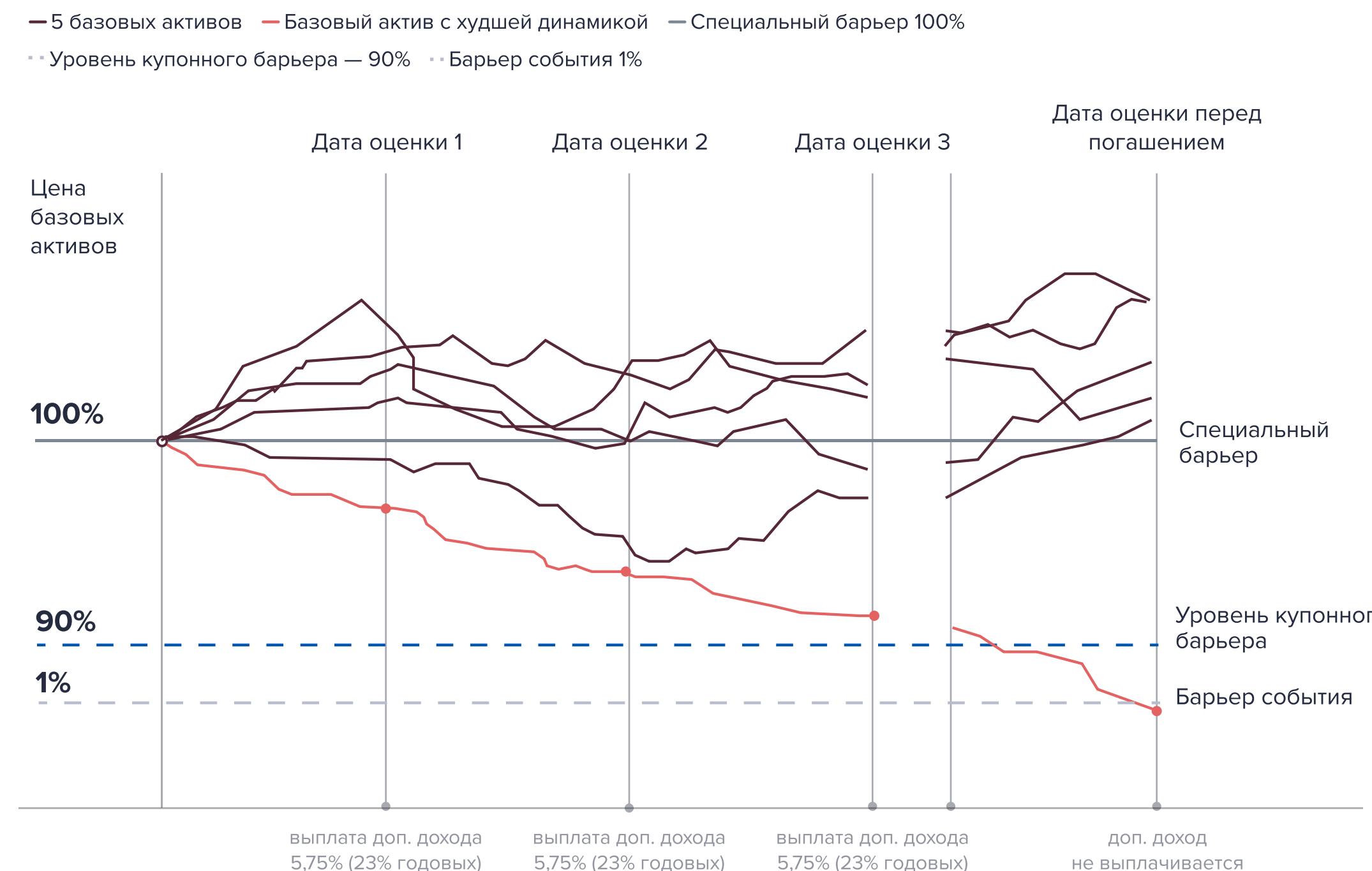
## ДАТА ОЦЕНКИ ПЕРЕД ПОГАШЕНИЕМ

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цены всех базовых активов выше Барьера события → Происходит погашение облигаций по номиналу. Инвестору возвращается 100% от номинала.

# Сценарий 3: Погашение ниже номинала в дату погашения

## Описание сценария:

- Во все даты оценки цена хотя бы одного из базовых активов находилась ниже Специального барьера.
- В даты оценки 1–11 цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов в дату оценки перед погашением ниже Уровня купонного барьера → Дополнительный доход не выплачивается.
- Цена худшего базового актива ниже Барьера события на 0,2% → Облигация погашается по 0,8% от номинала.



## ДАТА ОЦЕНКИ 1

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

## ДАТА ОЦЕНКИ 2

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

## ДАТА ОЦЕНКИ 3–11

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

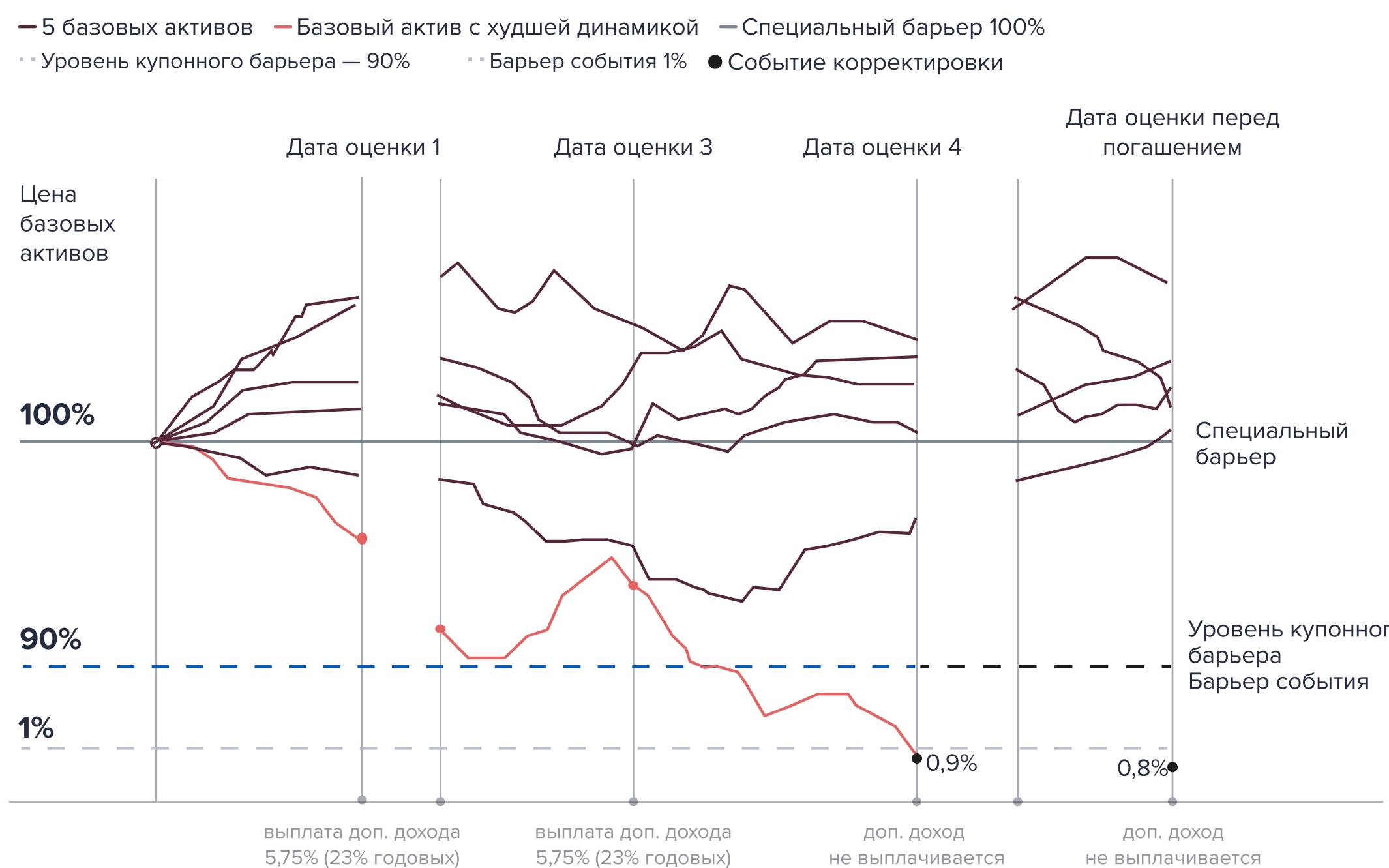
## ДАТА ОЦЕНКИ ПЕРЕД ПОГАШЕНИЕМ

- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Уровня купонного барьера → Дополнительный доход не выплачивается.
- Цена худшего базового актива ниже Барьера события на 0,2% → Происходит погашение облигаций по 0,8% от номинала в соответствии динамикой худшего базового актива относительно Начальной цены. Инвестору возвращается 0,8% от номинала.

# Сценарий 4: Событие корректировки

## Описание сценария:

- В даты оценки 1–3 цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- В дату оценки 4 происходит событие корректировки.
- В даты оценки 4–11 расчетным агентом цена базового актива, по которому наступило Событие корректировки, определена ниже Уровня купонного барьера → Дополнительный доход не выплачивается.
- Цена худшего базового актива определена расчетным агентом на дату оценки перед погашением, цена оказалась ниже Барьера события на 0,2% → Облигация погашается по 0,8% от номинала.



## ДАТА ОЦЕНКИ 1

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

## ДАТА ОЦЕНКИ 2–3

- Цена всех базовых активов выше Уровня купонного барьера → Выплачивается дополнительный доход 5,75% (23% годовых).
- Цена хотя бы одного из базовых активов ниже Специального барьера → Облигации продолжают обращаться, автопогашения не происходит.

## ДАТА ОЦЕНКИ 4

- Происходит событие Событие корректировки. Облигации продолжают обращаться.
- Расчетным агентом цена базового актива, по которому наступило Событие корректировки, определена ниже Уровня купонного барьера → Дополнительный доход не выплачивается.

## ДАТА ОЦЕНКИ 5–11

- Расчетным агентом цена базового актива, по которому наступило Событие корректировки, определена ниже Уровня купонного барьера → Дополнительный доход не выплачивается. Облигации продолжают обращаться.

## ДАТА ОЦЕНКИ ПЕРЕД ПОГАШЕНИЕМ

- Цена худшего базового актива определена расчетным агентом на дату оценки перед погашением, цена оказалась ниже Барьера события на 0,2% → Облигация погашается по 0,8% от номинала.

# Риски продукта

**Инвестициям в данный финансовый инструмент свойственны следующие ключевые риски:**

- Инструмент не предусматривает защиту капитала, поэтому инвестор может потерять часть или всю сумму вложенных средств.
- Доход по данному продукту вы получите только при благоприятном движении цен всех базовых активов.
- Отсутствие ликвидности. Невозможность выйти из инструмента до погашения. В случае продажи до погашения вы можете потерять часть инвестированных средств.
- При превышении всеми активами специального барьера погашения облигации будут погашены досрочно. Вы получите только инвестиированную сумму, увеличенную с учетом коэффициента специального события, и доход до даты погашения включительно. Вы не получите доход за даты, которые наступят после даты погашения облигаций.
- Если произойдут события, определенные решением о выпуске как события корректировки, потенциальные события корректировки и/или события нарушения расчета, например: делистинг базового актива, делистинг облигации, неликвидность и другие - вы можете потерять часть или всю сумму вложенных средств.
- Инструмент является структурной облигацией с залоговым обеспечением. Обязательной величиной средств на залоговом счете для данного выпуска является сумма в 10000 (десять тысяч) рублей. При этом данным залогом обеспечивается исполнение всех обязательств эмитента, включая выплату номинала и дохода при выполнении условий их получения. В случае дефолта эмитента требования инвесторов, не удовлетворенные за счет средств на залоговом счете, будут считаться погашенными, то есть у инвесторов может не быть возможности встать в очередь кредиторов в случае процедуры банкротства эмитента. Таким образом, в случае дефолта эмитента вы можете потерять часть или всю сумму вложенных средств.
- Кроме того, инвестициям в данный финансовый инструмент свойственны иные риски, являющиеся общими (типовыми) для многих инвестиций: риск изменения политической ситуации, экономические, правовые, рыночные (ценовой, процентный, валютный), кредитный, операционный, риск ликвидности и иные риски.
- Вы можете частично или полностью потерять инвестированные средства при неблагоприятном движении цены хотя бы одного базового актива.

**С полным описанием условий продукта и рисков вы можете ознакомиться по ссылкам:**

[Ссылка на паспорт продукта](#) [Ссылка на решение о выпуске](#)

[Ссылка на ключевые условия выпуска](#)

# Общая информация

Данный финансовый инструмент не является банковским депозитом, связанные с ним 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 данный финансовый инструмент не гарантированы государством.

Данный материал подготовлен компанией ООО «Ньютон Инвестиции» в информационных целях, носит ориентировочный характер и не является исчерпывающим.

Предназначен исключительно для внимания лиц, которым он адресован. Является конфиденциальным и не предназначен для дальнейшего распространения.

Размещаемые путем закрытой подписки облигации структурные бездокументарные с централизованным учетом прав серии 21, процентные дисконтируемые с залоговым обеспечением, предназначенные для **квалифицированных инвесторов**.

ISIN — RU000A107K75, эмитент — ООО «СФО БКС Структурные Ноты». Размер процентной ставки по купонному периоду — 0,01% годовых. Минимальная сумма инвестиций 300 000 рублей.

## БАЗОВЫЕ АКТИВЫ:

Обыкновенная акция ПАО «Группа ЛСР» — ISIN RU000A0JPFPO

Обыкновенная акция ПАО "ТГК-1" — ISIN RU000A0JNUDO

Обыкновенная акция ПАО "М.ВИДЕО" — ISIN RU000A0JPGAO

Обыкновенная акция ПАО АНК "БАШНЕФТЬ" — ISIN RU0007976957

Обыкновенная акция ПАО "РОССЕТИ" — ISIN RU000A0JPNN9

Обыкновенная акция ПАО "ГРУППА РЕНЕССАНС СТРАХОВАНИЕ" — ISIN RU000A0ZZM04

## Контрольные даты для определения дополнительного дохода и специального барьерного события:

18.08.2024 18.11.2024 18.02.2025 18.05.2025 18.08.2025 18.11.2025 18.02.2026 18.05.2026

18.08.2026 18.11.2026 18.02.2027

Дополнительная дата для определения дополнительного дохода: 18.05.2027

# Дисклеймер

Не является индивидуальной инвестиционной рекомендацией, финансовые инструменты либо операции, упомянутые в нем, могут не соответствовать вашему инвестиционному профилю и инвестиционным целям (ожиданиям). Определение соответствия финансового инструмента либо операции вашим интересам, инвестиционным целям, инвестиционному горизонту и уровню допустимого риска является вашей задачей. Ничто из информации, изложенной в данном материале, не должно быть расценено как публичная оферта, просьба или приглашение приобрести или продать изложенные в нем финансовые инструменты. Сведения о доходе, результатах инвестиционных решений являются индикативными, не включают расходы по выплате вознаграждения брокеру и иные возможные сопутствующие расходы, представлены исключительно для наглядности, не являются и не могут толковаться в качестве гарантий или обещаний получения доходов от инвестирования в упомянутые финансовые инструменты, на которые вы, возможно, рассчитываете, при условии использования предоставленной информации для принятия инвестиционных решений. Упомянутые ценные бумаги являются финансовым инструментом с повышенным риском и могут быть приобретены только квалифицированными инвесторами.

Решение о совершении сделок с указанными финансовыми инструментами должно быть вашим самостоятельным и добровольным решением, основанным на внимательной оценке целесообразности, экономической обоснованности, юридических и иных последствий, выгод и рисков, в том числе рисков, изложенных в Декларациях о рисках, размещенных на официальном сайте ООО «Ньютон Инвестиции» в сети интернет [newton.investments](http://newton.investments).

ООО «Ньютон Инвестиции» не несет ответственности за возможные убытки в случае совершения операций либо инвестирования в финансовые инструменты, упомянутые в презентации, и не рекомендует использовать указанную в презентации информацию в качестве единственного источника информации при принятии инвестиционного решения.

Не является «Рекламой» в понимании Федерального закона от 13.03.2006 N 38-ФЗ «О рекламе». Перед приобретением облигации со структурным доходом, вам необходимо ознакомиться со следующими документами: Решением о выпуске ценных бумаг, Документом, содержащим условия размещения ценных бумаг, паспортом продукта.

Брокерские и депозитарные услуги оказывает ООО «Ньютон Инвестиции», лицензия на осуществление брокерской деятельности № 045-14007-100000, лицензия на осуществление депозитарной деятельности № 045-14086-000100. Подробно с информацией об ООО «Ньютон Инвестиции», услугах и тарифах, а также с рисками, возникающими при инвестировании на рынке ценных бумаг, можно ознакомиться на <https://gazprombank.investments/broker/disclosure/>.

Инвестор несет расходы по выплате комиссии брокеру в размере 1% от инвестированной суммы. Все расчеты приведены без учета налогов и комиссии.

До даты начала размещения облигаций эмитент имеет право вносить изменения в ключевые условия выпуска. При этом полученное брокером поручение на совершение операций с облигацией будет действовать до момента его исполнения или отмены со стороны клиента.