

**Отчет об определении дополнительного дохода, переменного дохода по облигациям
Общества с ограниченной ответственностью «Компания специального назначения
«Структурные инвестиции 1» серии 01**

20.06.2017

Настоящим **Публичное акционерное общество Банк «Финансовая Корпорация Открытие»** (далее также – **«Расчетный агент»**), действуя на основании Агентского договора № ПРП-01-2016/678 от 1 июня 2016 г. (далее также – **«Договор»**) в качестве расчетного агента по документарным процентным неконвертируемым облигациям **Общества с ограниченной ответственностью «Компания специального назначения «Структурные инвестиции 1»** серии 01 (далее также – **«Эмитент»**) на предъявителя с обязательным централизованным хранением серии 01 в количестве 100 (Сто) штук номинальной стоимостью 100 000 000 (Сто миллионов) рублей каждая со сроком погашения 1 сентября 2023 г. с возможностью досрочного погашения по требованию их владельцев и по усмотрению эмитента, с купонным доходом и возможностью получения дополнительного дохода, государственный регистрационный номер выпуска ценных бумаг 4-01-36451-R от 6 октября 2014 г. (далее также – **«Облигации»**), для целей определения размера дополнительного дохода, переменного дохода по Облигациям сообщает Эмитенту следующие сведения:

1. В настоящем отчете сообщается размер дополнительного дохода, переменного дохода по Облигациям и иные показатели и обстоятельства, рассчитанные Расчетным агентом, которые влияют на определение переменного дохода.
2. Наименования переменных и обстоятельств, содержащихся в настоящем отчете и заключенных в кавычки («»), а также термины, использованные в настоящем отчете с заглавной буквы, имеют значения, определенные в соответствии с Договором и Сообщением об установлении формулы (сообщение об установлении формулы купонного дохода для всех купонных периодов, публикуемое Эмитентом в порядке, указанном в пунктах 9.3, 11 решения о выпуске ценных бумаг - Облигаций и пунктах 2.9, 9.1.2 проспекта ценных бумаг – Облигаций).
3. Порядковый номер Периода дополнительного дохода, для целей которого сообщаются настоящие сведения: 2.
4. Переменная **«КП»** составляет 0.00%.

Переменная **«КП»** рассчитана по следующей формуле:

$$КП = (\text{Удержание} * 365 * 100\%) / ((T_j - T_{(j-1)}) * \text{Nom}_{\text{общ}})$$
, где

T_j – дата окончания купонного периода, в которую производится выплата дополнительного дохода;

$T_{(j-1)}$ – дата начала купонного периода, в дату окончания которого производится выплата дополнительного дохода;

$\text{Nom}_{\text{общ}}$ – величина, равная совокупной номинальной стоимости размещенных Облигаций в рублях;

Удержание – сумма, удерживаемая Structured investments 1 SPV B.V. из Плавающего дохода согласно условиям Договора займа по итогам Периода Плавающего процента по Договору займа, завершающегося непосредственно перед датой выплаты дополнительного дохода, в которую производится соответствующая выплата дополнительного дохода, рассчитываемая как сумма следующих показателей:

- i. налоги, применимые к Structured investments 1 SPV B.V., уменьшающие сумму Плавающего процента, обязанность по уплате которых не может быть отложена на более поздний срок;
- ii. издержки, платежи и расходы, в том числе, но не ограничиваясь:
 1. полугодовой фиксированный процент, предусмотренный Договором займа;

2. расходы на проведение аудита;
3. расходы на предоставление информации административным органам;
4. расходы на процессингового агента (process agent);
5. банковские расходы;
6. обязательные государственные платежи;
7. управленческие расходы;
8. расходы, связанные с юридическим сопровождением (legal fees) и
9. расходы на выплату корпоративных налогов на доходы (прибыль),

понесенные Structured investments 1 SPV B.V. в течение Периода Плавающего процента по Договору займа, не покрытые процентами, начисляемыми по сумме Резервного фонда, зачисленной на Расчетный счет, или основной суммой Резервного фонда и отраженные в Полугодовом отчете Structured investments 1 SPV B.V., но не включая Плавающий Процент и Финальный Процент по Договору займа и суммы, выплаченные в качестве комиссии за оригинацию сделки в соответствии с Договором займа.

При этом, суммы, указанные в настоящем пункте и номинированные в Евро конвертируются в рубли по рыночному курсу, определяемому и применяемому Structured investments 1 SPV B.V. (действующим разумно).

Компоненты переменной «Удержание» рассчитываются Расчетным агентом в размере, не зависящем от действий Эмитента, осуществляемых после раскрытия Сообщения об установлении формулы, а также от усмотрения Эмитента, которое будет иным образом проявлено после раскрытия Сообщения об установлении формулы.

Согласно сведениям, сообщенным Расчетному агенту в виде Полугодового отчета Structured investments 1 SPV B.V. от 16.06.2017, показатель «Удержание» составил 0,00 (ноль целых 00 сотых) рублей, исходя из следующих компонентов показателя:

Компонент	Размер, в росс. руб.
1) Налоги, применимые к Structured investments 1 SPV B.V., уменьшающие сумму Плавающего процента, обязанность по уплате которых не может быть отложена на более поздний срок	0.00 руб.
2) Издержки, платежи и расходы, в том числе, но не ограничиваясь:	0.00 руб.
2.1) полугодовой фиксированный процент, предусмотренный Договором займа	0.00 руб.
2.2) расходы на проведение аудита	0.00 руб.
2.3) расходы на предоставление информации административным органам	0.00 руб.
2.4) расходы на процессингового агента (process agent)	0.00 руб.
2.5) банковские расходы	0.00 руб.
2.6) обязательные государственные платежи	0.00 руб.
2.7) управленческие расходы	0.00 руб.
2.8) расходы, связанные с правовым сопровождением (legal fees) и	0.00 руб.

2.9) расходы на выплату корпоративных налогов на доходы (прибыль)	0.00 руб.
ИТОГО	0.00 руб.

5. Информация о наличии следующего обстоятельства:

«в период, равный шести месяцам, и оканчивающийся в дату, наступающую за 8 дней до даты выплаты дополнительного дохода, Russia Corporate Fund Ltd. не производит выплату дивидендов по Акциям»,

(1) предоставленная Structured investments 1 SPV B.V. Расчетному агенту:

В период с 17 декабря 2016 года по 23 июня 2017 года Russia Corporate Fund Ltd. произвела выплату дивидендов по своим привилегированным акциям класса «А» в сумме 51 347 784,66 руб.8 июня 2017 года

(2) раскрытая на следующей странице в системе Bloomberg RUSCCFA:KY:

информация на странице в системе Bloomberg RUSCCFA:KY не содержит сведений о выплате дивидендов по акциям

Установлено наличие указанного обстоятельства.

Переменная «Ставка фонда» – 3.00% процентов годовых.

6. Переменная «Ставка ПДі» составляет 1.029777%.

«Ставка ПДі» рассчитана по следующей формуле:

Ставка ПДі = (КУ*Ставка фонда – КП), где

КУ – Коэффициент участия, равный 0.343259;

Переменные «Ставка фонда» и «КП» установлены Расчетным агентом в настоящем отчете выше.

7. Величина переменного дохода (ПДі) по каждой Облигации определяется Расчетным агентом по следующей формуле

$$ПДі = \text{Ставка ПДі} * \text{Nom} * (T_j - T_{(j-1)}) / (365 * 100\%)$$

Если переменный доход на одну Облигацию, рассчитанный в соответствии с указанной выше формулой, имеет величину меньше 0 рублей 00 копеек, то величина переменного дохода на одну Облигацию для соответствующей даты выплаты дополнительного дохода признается равной 0 рублей 00 копеек.

Переменный доход (ПДі) по каждой Облигации составляет 513 477.85 **российских рублей**.

8. Величина дополнительного дохода по каждой Облигации с учетом размера дополнительной части дополнительного дохода, рассчитанного Расчетным агентом и сообщенного Эмитенту в соответствии с Договором: 513 477.85 (пятьсот тринадцать тысяч четыреста семьдесят семь целых восемьдесят пять сотых) **российских рублей**.



ПОДПИСАНО ОТ ИМЕНИ РАСЧЕТНОГО АГЕНТА

Фамилия, имя, отчество: Пашкевич Андрей Николаевич

Должность: Вице-президент – Директор Департамента рынков капитала

Основание полномочий: Доверенность №01/474 от 23.03.2017

Прошито и пронумеровано 3 (три) листа

Должность:

Вице-Президент – Директор Департамента рынков капитала

Подпись:

 / А.Н. Пашкевич /
М.П.

