

## Сообщение

### о существенном факте о сведениях, оказывающих, по мнению эмитента, существенное влияние на стоимость его эмиссионных ценных бумаг

1. Общие сведения	
1.1. Полное фирменное наименование эмитента (для некоммерческой организации – наименование)	<i>Общество с ограниченной ответственностью «ВТБ Капитал Финанс»</i>
1.2. Сокращенное фирменное наименование эмитента	<i>ООО «ВТБ Капитал Финанс»</i>
1.3. Место нахождения эмитента	<i>Российская Федерация, 123100, г. Москва, Пресненская набережная, дом 12</i>
1.4. ОГРН эмитента	<i>1117746422243</i>
1.5. ИНН эмитента	<i>7710890150</i>
1.6. Уникальный код эмитента, присвоенный регистрирующим органом	<i>36408-R</i>
1.7. Адрес страницы в сети Интернет, используемой эмитентом для раскрытия информации	<i><a href="http://vtbfinance.ru/#VTB_Capital_Finance_disclosure">http://vtbfinance.ru/#VTB_Capital_Finance_disclosure</a> <a href="http://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=30352">http://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=30352</a></i>

2. Содержание сообщения	
Сведения об установлении формулы дополнительного дохода	
<p>2.1. Вид, категория (тип), серия и иные идентификационные признаки размещаемых ценных бумаг: <i>облигации документарные процентные неконвертируемые на предъявителя с обязательным централизованным хранением серии 18 в количестве 2 000 000 (Два миллиона) штук номинальной стоимостью 1 000 (Одна тысяча) рублей каждая со сроком погашения в 3 640 (Три тысячи шестьсот сороковой) день с даты начала размещения облигаций, размещаемые путем открытой подписки с возможностью досрочного погашения по требованию их владельцев и досрочного (частичного досрочного) погашения по усмотрению эмитента с фиксированным купонным доходом и возможностью получения дополнительного дохода (государственный регистрационный номер выпуска: 4-18-36408-R, дата государственной регистрации: 18 апреля 2013 г.; далее также – «Облигации», а по отдельности - «Облигация»).</i></p> <p><i>Примечание: если в настоящем сообщении не указано иное, термины, употребляемые в нем с заглавной буквы, имеют значение, указанное в решении о выпуске ценных бумаг – Облигаций.</i></p> <p>2.2. Дата принятия решения: <i>«19» февраля 2014 г.</i> Орган, принявший решение об установлении формулы дополнительного дохода: <i>Решение принято приказом единоличного исполнительного органа – Генерального директора Общества с ограниченной ответственностью «ВТБ Капитал Финанс» (далее также – «Эмитент»), Приказ от «19» февраля 2014 г. № 19-02-2014/1.</i></p> <p>2.3. Формула определения дополнительного дохода, подлежащего выплате по одной Облигации: <i>(Номинал x Ставка)/100%,</i> где <i>Номинал – номинальная стоимость одной Облигации;</i> <i>Ставка – Процентная ставка дополнительного дохода по Облигациям, определяемая в порядке, указанном в настоящем сообщении ниже (далее - Ставка).</i></p> <p><u><i>Если наименьшее из значений Базового актива за период времени от Даты 1 (включительно) до Даты 2 (включительно) было больше значения Множителя 1, а наибольшее из значений Базового актива за указанный период было меньше значения Множителя 2, то Ставка равна значению Множителя 3.</i></u></p> <p><u><i>Иначе Ставка равна 0%</i></u></p> <p><u><i>Примечание: указанные наибольшее и наименьшее из значений Базового актива за период времени</i></u></p>	

от Даты 1 (включительно) до Даты 2 (включительно) признаются Расчетными значениями Базового актива в значении, придаваемом данному термину подп. б) п. 15.2.1 решения о выпуске ценных бумаг – Облигаций. Значения Базового актива за период времени от Даты 1 (включительно) до Даты 2 (включительно) признаются промежуточными значениями Базового актива для целей определения указанных Расчетных значений Базового актива.

*Значения Множителя 1, Множителя 2 и Множителя 3 определяются Эмитентом до даты начала размещения Облигаций и раскрывается в порядке, предусмотренном решением о выпуске ценных бумаг – Облигаций, проспектом ценных бумаг, утвержденным в отношении Облигаций.*

*Множитель 1 и Множитель 2 имеют числовые значения.*

*Множитель 3 имеет значение, выраженное в процентах.*

*Значения Множителя 1, Множителя 2, Множителя 3 не могут быть отрицательными.*

Базовый актив: Курс рубля Российской Федерации к доллару США, выраженный как количество рублей за 1 (один) доллар США, для расчетов на следующий рабочий день, рассчитанный Чикагской товарной биржей (Chicago Mercantile Exchange) и объявляемый Ассоциацией трейдеров развивающихся рынков (Emerging Market Traders Association; далее — «EMTA») на странице EMTA в системе Reuters, а если такая страница недоступна — на другой странице системы Reuters или иной системы, на которой публикуется такая информация, примерно в 13 часов 30 минут по московскому времени (далее также – «Курс RUB CME-EMTA»)

Дата 1: 27 февраля 2014

Дата 2: 27 февраля 2015

*К порядку расчета Базового актива, если в настоящем сообщении не указано иное, применяются правила, предусмотренные п. 15.4.1 решения о выпуске ценных бумаг – Облигаций.*

2.4. Порядковые номера купонов (кроме двадцатого), в даты окончания которых осуществляется выплата дополнительного дохода:

*Не указывается, поскольку дополнительный доход выплачивается только при досрочном погашении Облигаций.*

2.5. Порядок определения величины дополнительного дохода, выплачиваемого при частичном досрочном погашении:

*Не применимо*

2.6. События, при наступлении которых Базовый актив (Базовые активы) считается (считаются) равным (равными) нулю («События обнуления Базового актива/Базовых активов»):

*Не применимо*

2.7. Источник опубликования информации о значении Базового актива, которое будет использоваться при определении величины дополнительного дохода:

*Страница EMTA в системе «Рейтерс» (Reuters);*

*Тикер <EMRUEMRU Index> в системе «Блумберг» (Bloomberg);*

*Официальный сайт CME Group: <http://www.cmegroup.com/trading/fx/daily-ruble-rate.html>*

*Если информация своевременно опубликована в двух или более из указанных источников, предпочтение отдается информации, опубликованной на официальном сайте CME Group: <http://www.cmegroup.com/trading/fx/daily-ruble-rate.html>, а если на указанной странице информация не опубликована – информации, опубликованной Странице EMTA в системе «Рейтерс» (Reuters).*

2.8. Дата, в которую осуществляется выплата дополнительного дохода:

*Дата досрочного погашения Облигаций по усмотрению эмитента.*

*Дата досрочного погашения Облигаций по усмотрению эмитента определяется на основании решения уполномоченного органа Эмитента, принятого не позднее, чем в 17-30 по московскому времени рабочего дня, непосредственно предшествующего дате начала срока для направления*

*оферт с предложением заключить Предварительные договоры (как данный термин определен в решении о выпуске ценных бумаг - Облигаций). При этом, указанная дата досрочного погашения Облигаций может наступать не ранее, чем через 2 дня после Даты 2. Раскрытие информации о досрочном погашении Облигаций по усмотрению Эмитента осуществляется в порядке, предусмотренном решением о выпуске ценных бумаг – Облигаций, проспектом ценных бумаг, утвержденным в отношении Облигаций.*

2.9. Событие (или События), при наступлении которых владельцы Облигаций приобретают право требовать досрочного погашения Облигаций в соответствии с пунктом 9.5.1 Решения о выпуске Облигаций (далее каждое из таких событий именуется «Барьерное событие»):

*Не применимо.*

2.10. Описание основных рисков, связанных с особенностями расчета дополнительного дохода по Облигациям:

*Ниже приводятся основные риски, связанные с особенностями расчета дополнительного дохода по Облигациям. Эмитент считает, что инвесторы должны учитывать каждое из этих обстоятельств, а также все иные риски, указанные в пункте 3.5 Проспекта ценных бумаг, зарегистрированного в отношении Облигаций при принятии решения о приобретении Облигаций.*

*Риски, связанные с финансовыми особенностями расчета дополнительного дохода по Облигациям:*

*Инвесторы не получают дополнительный доход, если Курс RUB CME-EMTA в течение срока от Даты 1 (включительно) до Даты 2 (включительно) достигнет значения выше или равного Множителю 2 или ниже или равного Множителю 1. Эмитент обращает внимание, что дополнительный доход не будет выплачиваться, если Курс RUB CME-EMTA будет иметь значение выше или равное Множителю 2 или ниже или равное Множителю 1 хотя бы в одну дату в течение срока от Даты 1 (включительно) до Даты 2 (включительно).*

*Величина дополнительного дохода не изменяется в зависимости от значения Курса RUB CME-EMTA в случае, если такой курс от Даты 1 (включительно) до Даты 2 (включительно) не достигнет значения выше Множителя 2 или ниже Множителя 1.*

*Курс RUB CME-EMTA может непредсказуемо изменяться в зависимости от многочисленных факторов, в том числе:*

- изменение спроса и предложения на нефть и иные энергоносители, а также изменение структуры экспорта и импорта Российской Федерации;*
- изменение спроса и предложения на валютном рынке;*
- изменение налоговой политики;*
- изменение монетарной политики Центрального банка Российской Федерации, Федеральной резервной системы США и (или) центральных банков иных государств;*
- изменение экономической ситуации, в том числе внешнеторгового платежного баланса и сальдо внешнеторговых операций, в России, США и (или) иных государствах;*
- внутригосударственные и международные события в сфере политики;*
- изменение законодательства Российской Федерации в отношении валютного рынка, рынка ценных бумаг, недвижимости и иных существенных изменений законодательства;*
- ожидание участниками валютного рынка возникновения определенных событий в будущем, в том числе факторов, указанных выше (изменение спроса и предложения на сырьевые ресурсы и энергоносители, изменение спроса и предложения на валютном рынке и т.д.);*
- иные факторы и события, имеющие возможность оказать влияние на Курс RUB CME-EMTA*

Валютный курс может изменяться в определенные даты в связи со сделками отдельных участников рынка. Эмитент считает, что инвесторы должны учитывать данное обстоятельство, а также то, что некоторые сделки, заключаемые участниками рынка, могут иметь спекулятивную направленность.

Прекращение или приостановка заключения сделок купли-продажи рублей Российской Федерации за доллары США на Чикагской товарной бирже (Chicago Mercantile Exchange) повлияет на порядок определения Курса RUB CME-EMTA и, в связи с этим, может существенно затронуть его значение.

История изменения значений Курса RUB CME-EMTA или курса рубля Российской Федерации к доллару США, рассчитываемого другими организаторами торгов (на других торговых площадках), ни в какой мере не свидетельствует о тех изменениях, которые произойдут в будущем.

Банк ВТБ (открытое акционерное общество) – лицо, предоставившее поручительство по Облигациям, и его аффилированные лица в процессе своей деятельности могут давать рекомендации, проводить исследования, изготавливать и публиковать иные информационные материалы, которые, так или иначе, касаются предполагаемых значений Курса RUB CME-EMTA или курса рубля Российской Федерации к доллару США, рассчитываемого другими организаторами торгов (на других торговых площадках). Такие рекомендации, исследования, информационные материалы не могут рассматриваться как рекомендации по приобретению Облигаций или гарантии получения определенного дохода по ним. Приобретая Облигации, инвесторы должны принимать самостоятельное инвестиционное решение на основе анализа всех возможных факторов и не исходить исключительно или в определяющей мере из указанных рекомендаций, исследований или материалов.

#### Правовые риски, связанные с особенностями расчета дополнительного дохода по Облигациям:

В Российской Федерации, по мнению Эмитента, не существует устоявшейся судебной практики касательно облигаций с доходом, зависящим от курсов валюты, фондовых индексов, сложившихся на публичном рынке цен на сырье, товары, финансовые инструменты или иных переменных.

Законодательство Российской Федерации (включая здесь и далее подзаконное регулирование), регулирующие отношения в сфере предпринимательства, в частности, в области эмиссии облигаций юридическими лицами и ситуаций, связанных с просрочкой исполнения обязательств (дефолтами) по облигациям, имеет относительно короткую историю (по разным оценкам от 15 до 20 лет) и подвержено периодическим изменениям.

В этой связи, каждый потенциальный приобретатель Облигаций должен осуществить самостоятельную оценку либо получить юридическую консультацию или заключение относительно рисков, связанных, среди прочего, со следующими обстоятельствами:

1. Неопределенность или неоднозначность российского законодательства в отношении тех или иных вопросов, связанных с различными финансовыми продуктами, включая облигации с дополнительным переменным доходом.
2. Возможные изменения российского законодательства и судебной практики.
3. Непредсказуемость развития судебной практики. Возможность расширительного применения различных норм права, в том числе применение отдельных норм права по аналогии (включая, в частности, возможность применения положений законодательства, регулирующих отношения, связанные с производными финансовыми инструментами, играми и пари и т.д.) или иного толкования, неблагоприятного для инвесторов в финансовые продукты.
4. Ограничение возможности инвестирования в Облигации для некоторых инвесторов в соответствии с действующим законодательством (включая, среди прочего, прямые запреты, налоговое регулирование и ограничения в связи с пруденциальными требованиями (например требованиями к капиталу)), учредительными и иными внутренними документами таких инвесторов.

Общее описание особенностей регулирования, касающегося сделок игр и пари, а также производных финансовых инструментов.

*В соответствии с п. 2 ст. 1062 Гражданского кодекса Российской Федерации требования, связанные с участием в сделках, предусматривающих обязанность стороны или сторон сделки уплачивать денежные суммы в зависимости от изменения цен на товары, ценные бумаги, курса соответствующей валюты, величины процентных ставок, либо от наступления иного обстоятельства, которое предусмотрено законом и относительно которого неизвестно, наступит оно или не наступит, подлежат судебной защите при соблюдении определенных условий.*

*Такие требования пользуются судебной защитой, если (i) хотя бы одной из сторон сделки является юридическое лицо, получившее лицензию на осуществление банковских операций или лицензию на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, либо (ii) хотя бы одной из сторон сделки, заключенной на бирже, является юридическое лицо, получившее лицензию, на основании которой возможно заключение сделок на бирже. Требования, связанные с участием граждан в указанных в сделках, подлежат судебной защите только при условии их заключения на бирже.*

*В соответствии с абзацами 32-35 ст. 2 Федерального закона «О рынке ценных бумаг» от 22.04.1996 № 39-ФЗ с изменениями и дополнениями (далее – «Закон о рынке ценных бумаг») производный финансовый инструмент - договор, за исключением договора репо, предусматривающий одну или несколько из следующих обязанностей:*

*1) обязанность сторон или стороны договора периодически или одновременно уплачивать денежные суммы, в том числе в случае предъявления требований другой стороной, в зависимости от изменения цен на товары, ценные бумаги, курса соответствующей валюты, величины процентных ставок, уровня инфляции, значений, рассчитываемых на основании цен производных финансовых инструментов, значений показателей, составляющих официальную статистическую информацию, значений физических, биологических и (или) химических показателей состояния окружающей среды, от наступления обстоятельства, свидетельствующего о неисполнении или ненадлежащем исполнении одним или несколькими юридическими лицами, государствами или муниципальными образованияами своих обязанностей (за исключением договора поручительства и договора страхования), либо иного обстоятельства, которое предусмотрено федеральным законом или нормативными актами Центрального банка Российской Федерации и относительно которого неизвестно, наступит оно или не наступит, а также от изменения значений, рассчитываемых на основании одного или совокупности нескольких указанных в настоящем пункте показателей. При этом такой договор может также предусматривать обязанность сторон или стороны договора передать другой стороне ценные бумаги, товар или валюту либо обязанность заключить договор, являющийся производным финансовым инструментом;*

*2) обязанность сторон или стороны на условиях, определенных при заключении договора, в случае предъявления требования другой стороной купить или продать ценные бумаги, валюту или товар либо заключить договор, являющийся производным финансовым инструментом;*

*3) обязанность одной стороны передать ценные бумаги, валюту или товар в собственность другой стороне не ранее третьего дня после дня заключения договора, обязанность другой стороны принять и оплатить указанное имущество и указание на то, что такой договор является производным финансовым инструментом.*

*Виды договоров (контрактов), являющихся производными финансовыми инструментами, предусмотрены Положением о видах производных финансовых инструментов, утвержденным Приказом ФСФР России от 04.03.2010 № 10-13/пз-н*

*В соответствии с п. 1 ст. 51.4 Закона о рынке ценных бумаг заключение участниками торгов на торгах фондовой биржи договоров, являющихся производными финансовыми инструментами, допускается при условии, что другой стороной по таким договорам является центральный контрагент. Банком России могут быть установлены иные случаи, когда договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, заключаются только при условии, что другой стороной по таким договорам является лицо, осуществляющее функции центрального*

контрагента.

*В соответствии с п. 2 ст. 51.4 Федерального закона «О рынке ценных бумаг» договором, являющимся производным финансовым инструментом, может быть определено лицо, которое на основании соглашений со сторонами указанного договора определяет сумму денежных средств (количество иного имущества), подлежащих передаче по договору, являющемуся производным финансовым инструментом, предъявляет сторонам требования, предусмотренные таким договором, совершает иные действия, необходимые для осуществления прав и исполнения обязанностей каждой из сторон по указанному договору. Таким лицом может являться клиринговая организация, кредитная организация, брокер или депозитарий.*

**НАСТОЯЩЕЕ ОПИСАНИЕ СОСТАВЛЕНО ДЛЯ ЦЕЛЕЙ ОТРАЖЕНИЯ РИСКОВ, СВЯЗАННЫХ С ИНВЕСТИЦИЯМИ В ОБЛИГАЦИИ СЕРИИ 18. ПЕРЕЧЕНЬ РИСКОВ, ПРИВЕДЕННЫЙ ВЫШЕ, НЕ ЯВЛЯЕТСЯ ИСЧЕРПЫВАЮЩИМ. КАЖДЫЙ ПОТЕНЦИАЛЬНЫЙ ПРИОБРЕТАТЕЛЬ ОБЛИГАЦИЙ ДОЛЖЕН ОСУЩЕСТВЛЯТЬ САМОСТОЯТЕЛЬНЫЙ АНАЛИЗ РИСКОВ ДЛЯ ЦЕЛИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ ВОЗМОЖНОСТИ ИНВЕСТИРОВАНИЯ В ЦЕННЫЕ БУМАГИ И СОПРЯЖЕННЫХ С ТАКИМИ ИНВЕСТИЦИЯМИ РИСКОВ.**

3. Подпись

3.1. Генеральный директор  
Общества с ограниченной ответственностью  
«ВТБ Капитал Финанс»

\_\_\_\_\_  
(подпись)

Д.С. Суспицын

3.2. Дата “ 19 ”        февраля 2014 г.

М.П.