

Zasady LOKATY Strukturyzowanej Puchar Zysków

Niniejszy dokument określa szczegółowe parametry
LOKATY Strukturyzowanej Puchar Zysków

Nazwa lokaty	LOKATA Strukturyzowana Puchar Zysków																						
Minimalna kwota lokaty	1 000 PLN																						
Data rozpoczęcia okresu subskrypcji	29.05.2012																						
Data zakończenia okresu subskrypcji	12.06.2012																						
Data rozpoczęcia lokaty strukturyzowanej	13.06.2012																						
Data zakończenia lokaty strukturyzowanej	14.06.2013																						
Nazwa aktywa bazowego	Koszyk spółek: <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <thead> <tr> <th>I</th> <th>Nazwa spółki</th> <th>Giełda</th> <th>Bloomberg</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td> <td>Carlsberg AS-B</td> <td>Kopenhaga</td> <td>CARLB DC Equity</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>Adidas AG</td> <td>Xetra</td> <td>ADS GY Equity</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>The Coca-Cola Co</td> <td>Nowy Jork</td> <td>KO UN Equity</td> </tr> <tr> <td>4</td> <td>McDonald's Corp</td> <td>Nowy Jork</td> <td>MCD UN Equity</td> </tr> </tbody> </table>			I	Nazwa spółki	Giełda	Bloomberg	1	Carlsberg AS-B	Kopenhaga	CARLB DC Equity	2	Adidas AG	Xetra	ADS GY Equity	3	The Coca-Cola Co	Nowy Jork	KO UN Equity	4	McDonald's Corp	Nowy Jork	MCD UN Equity
I	Nazwa spółki	Giełda	Bloomberg																				
1	Carlsberg AS-B	Kopenhaga	CARLB DC Equity																				
2	Adidas AG	Xetra	ADS GY Equity																				
3	The Coca-Cola Co	Nowy Jork	KO UN Equity																				
4	McDonald's Corp	Nowy Jork	MCD UN Equity																				
Gwarancja kapitału	100% ochrony kapitału na zakończenie inwestycji																						
Formuła obliczania odsetek od lokaty	Oprocentowanie lokaty obliczane jest według poniższej formuły: $Kupon \cdot \frac{N_i}{N_{Total}}$ gdzie: <p>N_i - liczba dni kalendarzowych pomiędzy Dniem Pierwszej Obserwacji a Dniem Ostatniej Obserwacji (z włączeniem tych dni), w których dla każdego $i=1,..,4$ spełniony jest warunek $S_i(t) \geq S_i(0)$</p> <p>$S_i(t)$ - oficjalny kurs zamknięcia i-tej spółki w Dniu Obserwacji (t). Jeżeli w danym Dniu Obserwacji (t) dla danej spółki i nie będzie dostępne kwotowanie na odpowiedniej giełdzie (np. sobota, święto), wówczas za oficjalny kurs zamknięcia w tym dniu zostanie uznany kurs spółki z poprzedniego dnia kiedy kwotowanie było dostępne.</p> <p>$S_i(0)$ - oficjalny kurs zamknięcia i-tej spółki w Dniu Pierwszej Obserwacji</p> <p>Dzień Pierwszej Obserwacji - 13.06.2012</p> <p>Dzień Ostatniej Obserwacji - 12.06.2013</p> <p>Dzień Obserwacji (t) - każdy kolejny dzień kalendarzowy t, począwszy od Dnia Pierwszej Obserwacji (t=0) do Dnia Ostatniej Obserwacji (t=364)</p> <p>N_{Total} - liczba wszystkich dni kalendarzowych pomiędzy Dniem Pierwszej Obserwacji a Dniem Ostatniej Obserwacji. $N_{Total} = 365$</p>																						

	<p>Kupon – wysokość oprocentowania lokaty. Według danych rynkowych z dnia 23.05.2012 wartość ta wyniosłaby 13%. Ostateczna wartość zostanie ustalona w dniu 13.06.2012 i będzie nie niższa niż 11,50%.</p> <p>Jeżeli wartość aktywa bazowego nie będzie dostępna w danym dniu, wtedy dniem obserwacji będzie następny dzień, w którym dane te będą dostępne.</p>
Formuła obliczania odsetek w przypadku wycofania lokaty	Wysokość odsetek w przypadku wycofania lokaty przed terminem uzależniona jest od rynkowej wyceny strategii inwestycyjnej w dniu realizacji zerwania.
Oprocentowanie gwarantowane	0%
Cykl wycofania lokaty	Zerwania lokat odbywają się w cyklach tygodniowych. Cykl trwa od środy do wtorku włącznie każdego tygodnia okresu umownego.
Opłata „O” za wycofanie lokaty	<p>Maksymalna stawka opłaty za zerwanie wynosi 6,50%.</p> <p>Wysokość opłaty zależy od daty złożenia dyspozycji zerwania lokaty strukturyzowanej i została podana w tabeli poniżej z dokładnością do dwóch miejsc po przecinku:</p>

Data złożenia dyspozycji		Opłata za zerwanie*
od dnia	do dnia	
2012-06-13	2012-06-19	6,41%
2012-06-20	2012-06-26	6,29%
2012-06-27	2012-07-03	6,16%
2012-07-04	2012-07-10	6,04%
2012-07-11	2012-07-17	5,91%
2012-07-18	2012-07-24	5,79%
2012-07-25	2012-07-31	5,66%
2012-08-01	2012-08-07	5,54%
2012-08-08	2012-08-14	5,41%
2012-08-15	2012-08-21	5,29%
2012-08-22	2012-08-28	5,16%
2012-08-29	2012-09-04	5,04%
2012-09-05	2012-09-11	4,92%
2012-09-12	2012-09-18	4,79%
2012-09-19	2012-09-25	4,67%
2012-09-26	2012-10-02	4,54%
2012-10-03	2012-10-09	4,42%
2012-10-10	2012-10-16	4,29%
2012-10-17	2012-10-23	4,17%
2012-10-24	2012-10-30	4,04%
2012-10-31	2012-11-06	3,92%
2012-11-07	2012-11-13	3,79%
2012-11-14	2012-11-20	3,67%
2012-11-21	2012-11-27	3,54%
2012-11-28	2012-12-04	3,42%
2012-12-05	2012-12-11	3,29%
2012-12-12	2012-12-18	3,17%
2012-12-19	2012-12-25	3,05%
2012-12-26	2013-01-01	2,92%
2013-01-02	2013-01-08	2,80%
2013-01-09	2013-01-15	2,67%
2013-01-16	2013-01-22	2,55%
2013-01-23	2013-01-29	2,42%
2013-01-30	2013-02-05	2,30%
2013-02-06	2013-02-12	2,17%
2013-02-13	2013-02-19	2,05%
2013-02-20	2013-02-26	1,92%
2013-02-27	2013-03-05	1,80%
2013-03-06	2013-03-12	1,67%
2013-03-13	2013-03-19	1,55%
2013-03-20	2013-03-26	1,42%
2013-03-27	2013-04-02	1,30%
2013-04-03	2013-04-09	1,18%
2013-04-10	2013-04-16	1,05%
2013-04-17	2013-04-23	0,93%
2013-04-24	2013-04-30	0,80%
2013-05-01	2013-05-07	0,68%
2013-05-08	2013-05-14	0,55%
2013-05-15	2013-05-21	0,43%
2013-05-22	2013-05-28	0,30%
2013-05-29	2013-06-04	0,18%
2013-06-05	2013-06-11	0,05%
2013-06-12	2013-06-14	0,00%

*Opłata za zerwanie obliczana jest jako iloczyn kwoty lokaty i podanej procentowej wartości prowizji. W tabeli powyżej podana z dokładnością do dwóch miejsc po przecinku.