

Zasady Lokaty Inwestycyjnej Rekiny Rynku

Niniejszy dokument określa szczegółowe parametry Lokaty Inwestycyjnej Rekiny Rynku w MultiBanku.

| Nazwa lokaty | Lokata Inwestycyjna Rekiny Rynku | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|--|----------------|---|--------------|-----------|---|--|----------------|---|---|---------------|---|-------------------------------|---------------|---|-------------|---------------|---|-------------|----------------|---|-------------------------|---------------|
| Data rozpoczęcia okresu subskrypcji | 8 czerwca 2010 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Data zakończenia okresu subskrypcji | 24 czerwca 2010 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Data rozpoczęcia lokaty inwestycyjnej | 25 czerwca 2010 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Data zakończenia lokaty inwestycyjnej | 20 grudnia 2011 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Nazwa i opis aktywa bazowego | <p>Koszyk akcji sześciu spółek:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 5%;">i</th> <th style="width: 65%;">Nazwa spółki</th> <th style="width: 30%;">Bloomberg</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">1</td> <td style="text-align: center;">CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION COMPANY LTD.</td> <td style="text-align: center;">1800 HK EQUITY</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">2</td> <td style="text-align: center;">CHINA TELECOMMUNICATIONS CORPORATION LTD.</td> <td style="text-align: center;">728 HK EQUITY</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">3</td> <td style="text-align: center;">CIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.</td> <td style="text-align: center;">SID UN EQUITY</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">4</td> <td style="text-align: center;">GAFISA S.A.</td> <td style="text-align: center;">GFA UN EQUITY</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">5</td> <td style="text-align: center;">GAZPROM OAO</td> <td style="text-align: center;">OGZD LI EQUITY</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">6</td> <td style="text-align: center;">MOBILE TELESYSTEMS OJSC</td> <td style="text-align: center;">MBT UN EQUITY</td> </tr> </tbody> </table> | | i | Nazwa spółki | Bloomberg | 1 | CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION COMPANY LTD. | 1800 HK EQUITY | 2 | CHINA TELECOMMUNICATIONS CORPORATION LTD. | 728 HK EQUITY | 3 | CIA SIDERURGICA NACIONAL S.A. | SID UN EQUITY | 4 | GAFISA S.A. | GFA UN EQUITY | 5 | GAZPROM OAO | OGZD LI EQUITY | 6 | MOBILE TELESYSTEMS OJSC | MBT UN EQUITY |
| i | Nazwa spółki | Bloomberg | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 | CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION COMPANY LTD. | 1800 HK EQUITY | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 2 | CHINA TELECOMMUNICATIONS CORPORATION LTD. | 728 HK EQUITY | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 3 | CIA SIDERURGICA NACIONAL S.A. | SID UN EQUITY | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 4 | GAFISA S.A. | GFA UN EQUITY | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 5 | GAZPROM OAO | OGZD LI EQUITY | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 6 | MOBILE TELESYSTEMS OJSC | MBT UN EQUITY | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Gwarancja kapitału | 100% zainwestowanego kapitału na zakończenie inwestycji | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Formuła obliczania odsetek od lokaty na zakończenie inwestycji | <p>Odsetki od lokaty naliczane i wypłacane są w dniu zakończenia lokaty według poniższej formuły:</p> <p style="text-align: center;">$Kwota\ lokaty * Kupon * (X_1 + X_2 + X_3)$</p> <p>gdzie:</p> <p>$X_j$ zdefiniowane jest następująco.</p> <p>Jeżeli dla każdego $i, i = 1, 2, \dots, 6$ $S_{ij} > S_{i0}$, to $X_j = 1$</p> <p>W przeciwnym przypadku $X_j = 0, \quad j = 1, 2, 3$</p> <p><i>Kupon</i> – wartość, która zostanie ustalona w dniu 25.06.2010 i będzie nie niższa niż 4,00%. Według danych rynkowych z dnia 04.06.2010 wartość ta wyniosłaby 4,30%.</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | |
|---|--|
| | <p>S_{i0} – wartość i-tego składnika koszyka w dniu 28.06.2010 r. na zamknięciu sesji,</p> <p>S_{i1} – wartość i-tego składnika koszyka w dniu 16.12.2010 r. na zamknięciu sesji,</p> <p>S_{i2} – wartość i-tego składnika koszyka w dniu 16.06.2011 r. na zamknięciu sesji,</p> <p>S_{i3} – wartość i-tego składnika koszyka w dniu 16.12.2011 r. na zamknięciu sesji.</p> <p>Jeżeli wartość któregokolwiek ze składników koszyka nie będzie dostępna w danym dniu, wtedy dniem obserwacji będzie następny dzień, w którym dane dla każdego składnika będą dostępne. Do wykonania obliczeń stosuje się cenę z zamknięcia sesji giełdowej na Hong Kong Stock Exchange dla $i=1$ oraz $i=2$, New York Stock Exchange dla $i=3$, $i=4$ oraz $i=6$, London Stock Exchange dla $i=5$.</p> <p>Jeśli w dowolnym dniu obserwacji nie będzie możliwe określenie wartości któregokolwiek ze składników koszyka (tj. akcji którejkolwiek ze spółek wskazanych jako aktywo bazowe), Bank, działając w dobrej wierze i zgodnie z zasadą należytej staranności, będzie miał prawo do ustalenia wartości odsetek od lokaty na podstawie własnych obliczeń.</p> |
| Oprocentowanie gwarantowane | 0 % |
| Formuła obliczania odsetek w przypadku wycofania lokaty | Wysokość odsetek w przypadku wycofania lokaty przed terminem uzależniona jest od rynkowej wartości strategii inwestycyjnej w dniu realizacji zerwania. |
| Cykl wycofania lokaty | Zerwania lokat odbywają się w cyklach tygodniowych. Cykl trwa od środy do wtorku włącznie każdego tygodnia okresu umownego. |
| Opłata za wycofanie lokaty | $O = W \cdot 7,66\% \cdot d / 543$, gdzie: W – kwota wycofania, d – ilość dni od dnia wycofania do dnia zakończenia lokaty |
| Minimalna kwota lokaty | 5 000 PLN |