

Certificado de Operações Estruturadas COE001015 – Range Accrual

1. Descrição

Com este COE, o investidor pode escolher duas maneiras de remunerar o valor investido, ficando comprado ou vendido no ativo de referência.

2. Cenários no vencimento

Cenários comprador



A – Se durante todo o período de operação a performance do ativo esteve dentro do intervalo de ganho, o investidor recebe o percentual do capital protegido mais o percentual total da taxa fixa acordada.

B – Se durante todo o período de operação a performance do ativo esteve parcialmente dentro do intervalo de ganho, o investidor recebe o percentual do capital protegido mais o percentual equivalente aos dias que a performance respeitou o intervalo.

C – Se durante todo o período de operação a performance do ativo não esteve dentro do intervalo de ganho, o investidor recebe o percentual do capital protegido.

Cenários vendedor



D – Se durante todo o período de operação a performance do ativo esteve dentro do intervalo de perda, o investidor recebe o percentual do capital protegido.

E – Se durante todo o período de operação a performance do ativo esteve parcialmente dentro do intervalo de perda, o investidor recebe o percentual do capital protegido mais o percentual equivalente aos dias que a performance não respeitou o intervalo.

F – Se durante todo o período de operação a performance do ativo não esteve dentro do intervalo de perda, o investidor recebe o percentual do capital protegido mais o percentual total da taxa fixa acordada.

Comprador

Cenários	Performance do ativo durante todo o período de operação	Resultado
A	Dentro do intervalo	Recebe % Capital protegido + % Total da taxa fixa
B	Parcialmente dentro do intervalo	Recebe % Capital protegido + % Equivalente
C	Totalmente fora do intervalo	Recebe % Capital protegido

Vendedor

Cenários	Performance do ativo durante todo o período de operação	Resultado
D	Dentro do intervalo	Recebe % Capital protegido
E	Parcialmente dentro do intervalo	Recebe % Capital protegido + % Equivalente
F	Totalmente fora do intervalo	Recebe % Capital protegido + % Total da taxa fixa

3. Classe de Ativos

O COE pode ser referenciado às seguintes classes de ativos:

- 3.1. Ações nacionais e internacionais;
- 3.2. Cesta;
- 3.3. Índices nacionais e índices internacionais;
- 3.4. Índices de preços;
- 3.5. Juros nacionais e internacionais;
- 3.6. Taxas de câmbio;
- 3.7. Títulos públicos e privados;
- 3.8. Commodities nacionais e internacionais.

4. Modalidade

Dependendo do percentual de proteção do capital investido, o COE pode ser classificado como:

- a) “*Capital Investido Garantido*” – modalidade na qual o investidor recebe, no mínimo, 100% do capital investido.
- b) “*Perda limitada ao capital investido*” – modalidade na qual o investidor tem a possibilidade de perda parcial, ou total, do capital investido.