

Certificado de Operações Estruturadas COE001060 – CCallSpread + VPutSpread

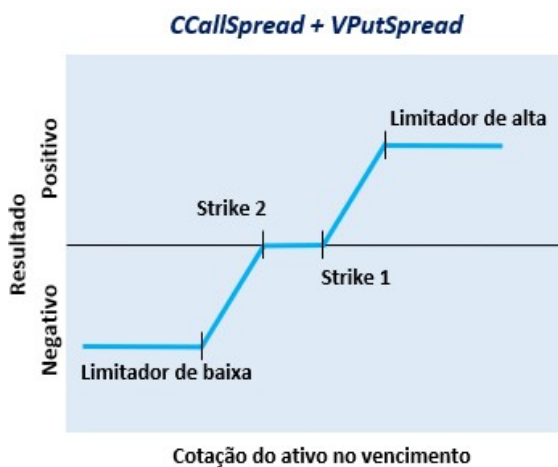
Descrição

Por meio desse COE o investidor pode escolher duas formas de remunerar o valor investido:

- Ficando comprado em uma *Call Spread* e vendido em uma *Put Spread*, de mesmo strike ou não, e referenciadas ao mesmo ativo objeto; ou
- Ficando vendido em uma *Call Spread* e comprado em uma *Put Spread*, de mesmo strike ou não, e referenciadas ao mesmo ativo objeto.

Cenários no vencimento

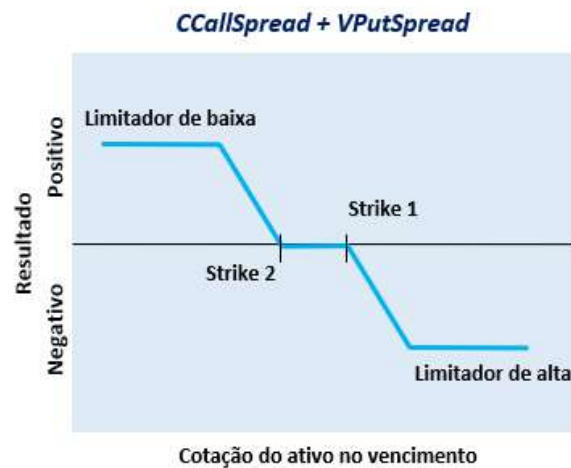
CENÁRIO COMPRADOR



Cenários	Preço final do Ativo	Resultado
A	Acima ou igual ao Limitador de Alta	Recebe o limite de alta da <i>Call Spread</i>
B	Entre o Strike e o Limitador de Alta	Recebe o ajuste da <i>Call Spread</i>
C	Igual ou entre Strikes 1 e 2	Recebe capital garantido

D	Entre o Limitador de Baixa e o Strike	Paga ajuste da <i>Put Spread</i>
E	Abaixo ou igual ao Limitador de Baixa	Paga o limite de baixa da <i>Put Spread</i>

CENÁRIOS VENDEDOR



Cenários	Preço final do Ativo	Resultado
A	Acima ou igual ao Limitador de Alta	Paga o limite de alta da <i>Call Spread</i>
B	Entre o Strike e o Limitador de Alta	Paga o ajuste da <i>Call Spread</i>
C	Igual ou entre Strike 1 e 2	Paga capital garantido
D	Entre o Limitador de Baixa e o Strike	Recebe ajuste da <i>Put Spread</i>
E	Abaixo ou igual ao Limitador de Baixa	Recebe o limite de baixa da <i>Put Spread</i>

Observação:

Os cenários de ganho refletem as parametrizações permitidas para a figura.

Informações complementares podem ser acessadas no Manual de Operações - COE.

Classe de Ativos

O COE pode ser referenciado às seguintes classes de ativos:

- Ações Nacionais e Internacionais;
- Cesta;
- Commodities Nacionais e Internacionais;
- Índices Nacionais e Índices Internacionais;
- Índices de Preços;
- Taxas de Câmbio;
- Títulos Públicos; e
- Juros nacionais e internacionais.

Modalidade

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

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