

Certificado de Operações Estruturadas **COE001063 – Straddle Puts spread + Call KO**

Descrição

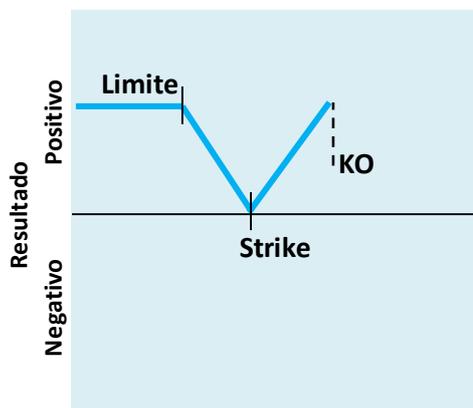
Por meio desse COE o investidor pode escolher duas formas de remunerar o valor investido:

- O investidor ganha proporcionalmente conforme a baixa do ativo de referência até determinado limite de alta (Puts spread) e também conforme a alta do ativo, até o nível da barreira de KO (Call KO), com a possibilidade de receber o rebate nesse atingimento da barreira.
- O investidor perde proporcionalmente conforme a baixa do ativo de referência até determinado limite de alta (Puts spread) e também conforme a alta do ativo, até o nível da barreira de KO (Call KO), com a possibilidade de pagar o rebate nesse atingimento da barreira.

Cenários no vencimento

CENÁRIO COMPRADOR

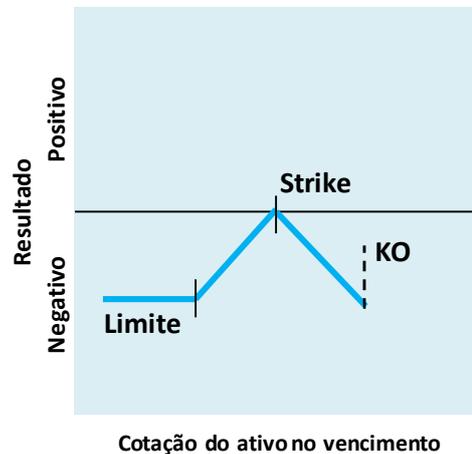
*Compra de PutSpread +
compra de Call KO*



Cenários	Opções Dependentes?	Atingimento de Barreiras	Preço Final do Ativo	Resultado
A	Indiferente	Não atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao Strike e acima do limite de baixa	% Variação positiva da Putsread
B	Indiferente	Não atinja a barreira	Terminou acima do Strike	% Variação positiva da Call KO
C	Não	Atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao Strike e acima do limite de alta	Rebate de Alta + % Variação positiva da Putsread
D	Não	Atinja a barreira	Terminou acima do Strike	Rebate de Alta
E	Indiferente	Não atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao limite de baixa	% Variação positiva limitada do Putsread
F	Não	Atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao limite de baixa	Rebate de Alta + % Variação positiva limitada da Putsread
G	Sim	Atinja a barreira	Indiferente	Rebate de Alta

CENÁRIO VENDEDOR

Venda de PutSpread + Venda de Call KO



Cenários	Opções Dependentes?	Atingimento de Barreiras	Preço Final do Ativo	Resultado
A	Indiferente	Não atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao Strike e acima do limite de baixa	% Variação negativa da Putsread
B	Indiferente	Não atinja a barreira	Terminou acima do Strike	% Variação negativa da Call KO
C	Não	Atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao Strike e acima do limite de alta	Rebate de Alta + % Variação negativa da Putsread
D	Não	Atinja a barreira	Terminou acima do Strike	Rebate de Alta
E	Indiferente	Não atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao limite de baixa	% Variação negativa limitada do Putsread
F	Não	Atinja a barreira	Terminou abaixo ou igual ao limite de baixa	Rebate de Alta + % Variação negativa limitada da Putsread
G	Sim	Atinja a barreira	Indiferente	Rebate de Alta

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;
- Índices nacionais e índices internacionais;
- Índices de preços;
- Juros nacionais e internacionais;
- Taxas de câmbio;
- Títulos públicos e privados; e
- Commodities 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.