

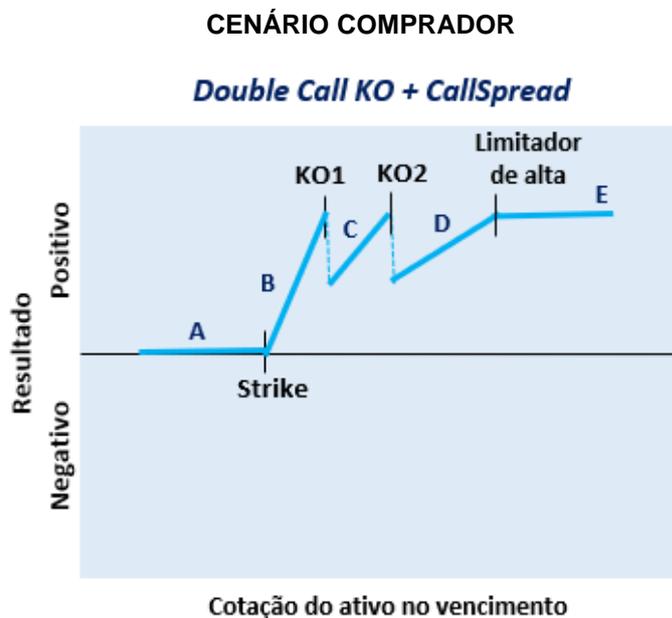
Certificado de Operações Estruturadas COE001056 – Double Call KO + CallSpread

Descrição

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

- Ficando comprado em duas Calls KO e em uma Call Spread, todas de mesmo strike e referenciadas ao mesmo ativo objeto; ou
- Ficando vendido em duas Calls KO e em uma Call Spread, todas de mesmo strike e referenciadas ao mesmo ativo objeto.

Cenários no vencimento

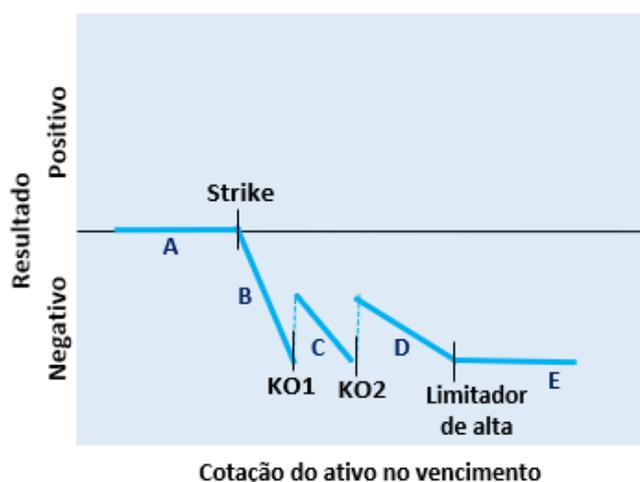


| Cenários | Atingimento de barreiras | Preço final do Ativo | Resultado |
|----------|--------------------------|--|---|
| A | KO1: Não KO2: Não | Abaixo do Strike | % do Capital Protegido |
| B | KO1: Não KO2: Não | Acima ou igual ao Strike e abaixo da barreira de KO1 | Recebe ajuste da Call KO 1 + Call KO 2 + CallSpread |
| C | KO1: Sim KO2: Não | Acima ou igual à barreira de KO1 e abaixo da de KO2 | Recebe ajuste da Call KO 2 + ajuste da CallSpread + rebate da Call KO 1 |

| | | | |
|----------|----------------------|--|---|
| D | KO1: Sim KO2: Sim | Acima ou igual à barreira de KO2 e abaixo do Limitador de Alta | Recebe ajuste da CallSpread + rebate da Call KO 1 + rebate da Call KO 2 |
| E | KO1: Sim KO2: Sim | Acima ou igual ao Limitador de Alta | Recebe rebate da Call KO 1 + rebate da Call KO 2 + limite de alta |

CENÁRIOS VENDEDOR

Double Call KO + CallSpread



| Cenários | Atingimento de barreiras | Preço final do Ativo | Resultado |
|----------|--------------------------|--|---|
| A | KO1: Não KO2: Não | Abaixo do Strike | % do Capital Protegido |
| B | KO1: Não KO2: Não | Acima ou igual ao Strike e abaixo da barreira de KO1 | Paga ajuste da Call KO 1 + Call KO 2 + CallSpread |
| C | KO1: Sim KO2: Não | Acima ou igual à barreira de KO1 e abaixo da de KO2 | Paga ajuste da Call KO 2 + ajuste da CallSpread + rebate da Call KO 1 |
| D | KO1: Sim KO2: Sim | Acima ou igual à barreira de KO2 e abaixo do Limitador de Alta | Paga ajuste da CallSpread + rebate da Call KO 1 + rebate da Call KO 2 |
| E | KO1: Sim KO2: Sim | Acima ou igual ao Limitador de Alta | Paga rebate da Call KO 1 + rebate da Call KO 2 + limite 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;
- 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.