

**Certificado de Operações Estruturadas**  
**COE001062 – Straddle Callspread + Put KO**

**Descrição**

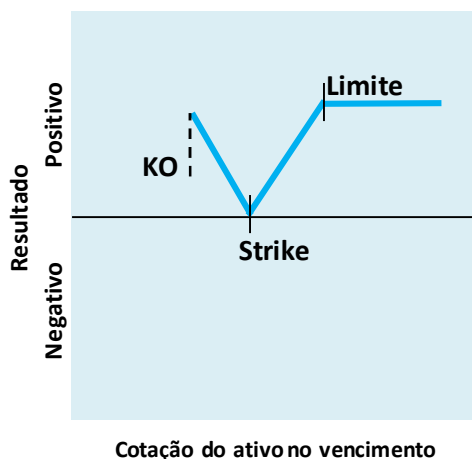
Por meio desse COE o investidor pode escolher duas formas de remunerar o valor investido:

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

## Cenários no vencimento

### CENÁRIO COMPRADOR

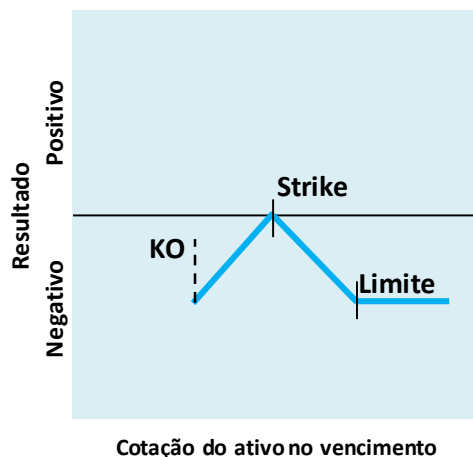
*Compra de CallSpread +  
compra de Put KO*



| Cenários | Opções Dependentes? | Atingimento de Barreiras | Preço Final do Ativo                                         | Resultado                                                    |
|----------|---------------------|--------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| <b>A</b> | Indiferente         | Não atinja a barreira    | Terminou acima ou igual ao Strike e abaixo do limite de alta | % Variação positiva do Callspread                            |
| <b>B</b> | Indiferente         | Não atinja a barreira    | Terminou abaixo do Strike                                    | % Variação positiva da Put KO                                |
| <b>C</b> | Não                 | Atinja a barreira        | Terminou acima ou igual ao Strike e abaixo do limite de alta | Rebate de Baixa + % Variação positiva da Callspread          |
| <b>D</b> | Não                 | Atinja a barreira        | Terminou abaixo do Strike                                    | Rebate de Baixa                                              |
| <b>E</b> | Indiferente         | Não atinja a barreira    | Terminou acima ou igual ao Limite de alta                    | % Variação positiva limitada do Callspread                   |
| <b>F</b> | Não                 | Atinja a barreira        | Terminou acima ou igual ao Limite de alta                    | Rebate de Baixa + % Variação positiva limitada da Callspread |
| <b>G</b> | Sim                 | Atinja a barreira        | Indiferente                                                  | Rebate de Baixa                                              |

## CENÁRIO VENDEDOR

### *Venda de Call Spread + Venda de Put KO*



| Cenários | Opções Dependentes? | Atingimento de Barreiras | Preço Final do Ativo                                         | Resultado                                                    |
|----------|---------------------|--------------------------|--------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| <b>A</b> | Indiferente         | Não atinja a barreira    | Terminou acima ou igual ao Strike e abaixo do limite de alta | % Variação negativa do Callspread                            |
| <b>B</b> | Indiferente         | Não atinja a barreira    | Terminou abaixo do Strike                                    | % Variação negativa da Put KO                                |
| <b>C</b> | Não                 | Atinja a barreira        | Terminou acima ou igual ao Strike e abaixo do limite de alta | Rebate de Baixa + % Variação negativa da Callspread          |
| <b>D</b> | Não                 | Atinja a barreira        | Terminou abaixo do Strike                                    | Rebate de Baixa                                              |
| <b>E</b> | Indiferente         | Não atinja a barreira    | Terminou acima ou igual ao Limite de alta                    | % Variação negativa limitada do Callspread                   |
| <b>F</b> | Não                 | Atinja a barreira        | Terminou acima ou igual ao Limite de alta                    | Rebate de Baixa + % Variação negativa limitada da Callspread |
| <b>G</b> | Sim                 | Atinja a barreira        | Indiferente                                                  | Rebate de Baixa                                              |

**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.