

Certificado de Operações Estruturadas
COE001059 – CCall KO Condicional + VPut KI
Double Bkt

Descrição

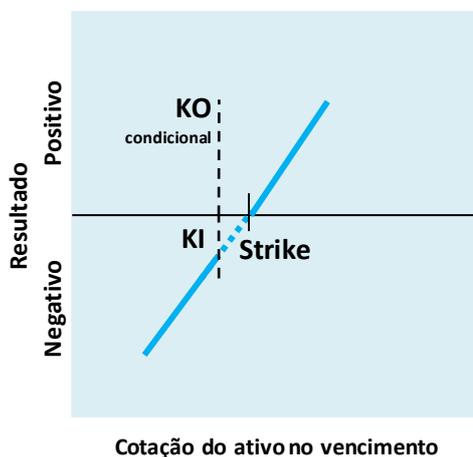
Por meio desse COE o investidor pode escolher duas formas de remunerar o valor investido:

- ficando comprado em uma Call, que pode ter uma barreira de KO condicional a barreira de KI da Put (mesmo nível e tipo de verificação) referenciada numa cesta (opções disponíveis: Standard, Best Of ou Worst of) e vendido em uma Put KI referenciada num tipo de cesta diferente da cesta da Call (opções disponíveis: Standard, Best Of ou Worst Of)
- ficando vendido em uma Call, que pode ter uma barreira de KO condicional a barreira de KI da Put (mesmo nível e tipo de verificação) referenciada numa cesta (opções disponíveis: Standard, Best Of ou Worst of) e comprado em uma Put KI referenciada num tipo de cesta diferente da cesta da Call (opções disponíveis: Standard, Best Of ou Worst Of)

Cenários no vencimento

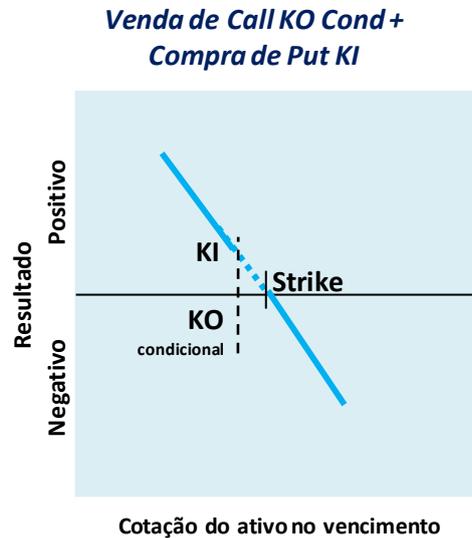
CENÁRIO COMPRADOR

Compra de Call KO Cond + Venda de Put KI



Cenários	Possui KO Condicional?	Compra de Call KO Condicional (cesta A) + Venda de Put KI (cesta B)			
		Atingimento da barreira de KI (e KO, se houver)	Preço final das Cestas		Resultado p/ Cliente
			Call	Put KI	
A	Indiferente	Não	Acima ou igual ao Strike 1	Indiferente	% Valor Nominal + Ajuste da Call - Rebate da Put KI
B	Indiferente	Não	Abaixo do Strike 1	Indiferente	% Valor Nominal - Rebate da Put KI
C	Não	Sim	Acima ou igual ao Strike 1	Acima do Strike 2	% Valor Nominal + Ajuste da Call
D	Não	Sim	Abaixo do Strike 1	Acima do Strike 2	% Valor Nominal
E	Sim	Sim	Indiferente	Acima do Strike 2	% Valor Nominal + Rebate da Call KO
F	Não	Sim	Acima ou igual ao Strike 1	Abaixo ou igual ao Strike 2	% Valor Nominal + Ajuste da Call - Ajuste da Put KI
G	Não	Sim	Abaixo do Strike 1	Abaixo ou igual ao Strike 2	% Valor Nominal - Ajuste da Put KI
H	Sim	Sim	Indiferente	Abaixo ou igual ao Strike 2	% Valor Nominal - Ajuste da Put KI + Rebate da Call KO

CENÁRIOS VENDEDOR



Observação:

Cenários	Possui KO Condicional?	Venda de Call KO Condicional (cesta A) + Compra de Put KI (cesta B)			
		Atingimento da barreira de KI (e KO, se houver)	Preço final das Cestas		Resultado p/ Cliente
			Call	Put KI	
A	Indiferente	Não	Acima ou igual ao Strike 1	Indiferente	% Valor Nominal - Ajuste da Call + Rebate da Put KI
B	Indiferente	Não	Abaixo do Strike 1	Indiferente	% Valor Nominal + Rebate da Put KI
C	Não	Sim	Acima ou igual ao Strike 1	Acima do Strike 2	% Valor Nominal - Ajuste da Call
D	Não	Sim	Abaixo do Strike 1	Acima do Strike 2	% Valor Nominal
E	Sim	Sim	Indiferente	Acima do Strike 2	% Valor Nominal - Rebate da Call KO
F	Não	Sim	Acima ou igual ao Strike 1	Abaixo ou igual ao Strike 2	% Valor Nominal - Ajuste da Call + Ajuste da Put KI
G	Não	Sim	Abaixo do Strike 1	Abaixo ou igual ao Strike 2	% Valor Nominal + Ajuste da Put KI
H	Sim	Sim	Indiferente	Abaixo ou igual ao Strike 2	% Valor Nominal + Ajuste da Put KI - Rebate da Call KO

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:

- Cesta;

Atualmente, a classe de ativo “Cesta” permite a inclusão dos seguintes ativos nas cestas:

- 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.