

Certificado de Operações Estruturadas COE001030 – Put Spread com KI + Call com KO

1. Descrição

Com este COE, o investidor pode escolher duas maneiras de remunerar o valor investido, ficando comprado ou vendido no ativo de referência.

2. Cenários no vencimento

Cenários comprador



A – Se no vencimento a cotação do ativo estiver igual ou acima da barreira de KO, o investidor recebe o percentual do capital protegido mais uma taxa fixa (rebate).

B – Se no vencimento a cotação do ativo estiver entre o Strike e a barreira de KO, o investidor recebe o percentual do capital protegido mais o percentual da variação positiva do ativo.

C – Se no vencimento a cotação do ativo for igual ao strike, o investidor recebe o percentual do capital protegido.

D – Se no vencimento a cotação do ativo estiver entre o strike e a barreira de KIKO, o investidor recebe o percentual do capital protegido.

E – Se no vencimento a cotação do ativo estiver entre a barreira KIKO e o limitador acordado, o investidor perde o percentual da variação negativa do ativo.

F – Se no vencimento a cotação do ativo estiver igual ou abaixo do limitador acordado, o investidor perde um percentual da máxima variação negativa do ativo.

Cenários vendedor



G – Se no vencimento a cotação do ativo estiver igual ou acima da barreira de KO, o investidor perde uma taxa fixa (rebate).

H – Se no vencimento a cotação do ativo estiver entre o strike e barreira de KO, o investidor perde o percentual da variação positiva do ativo.

I – Se no vencimento a cotação do ativo for igual ao strike, o investidor recebe o nominal investido.

J – Se no vencimento a cotação do ativo estiver entre o strike e a barreira de KIKO, o investidor recebe o nominal investido.

K – Se no vencimento a cotação do ativo estiver entre a barreira KIKO e o limitador acordado, o investidor recebe o percentual da variação negativa do ativo.

L – Se no vencimento a cotação do ativo estiver igual ou abaixo do limitador acordado, o investidor recebe o percentual da máxima variação negativa do ativo.

Comprador

Cenários	Cotação no vencimento	Resultado
A	Igual ou acima da barreira KO	Recebe % Capital protegido + Rebate
B	Entre o strike e a barreira de KO	Recebe % Capital protegido + % Variação positiva do ativo
C	Igual ao strike	Recebe % Capital protegido
D	Entre o strike e a barreira de KIKO	Recebe % Capital protegido
E	Entre a barreira de KIKO e o limitador	Perde % Variação negativa do ativo
F	Igual ou abaixo do limitador	Perde % Máx. Variação negativa do ativo

Vendedor

Cenários	Cotação no vencimento	Resultado
G	Igual ou acima da barreira de KO	Perde Rebate
H	Entre o strike e a barreira de KO	Perde % Variação positiva do ativo
I	Igual ao strike	Recebe Nominal investido
J	Entre o strike e a barreira de KIKO	Recebe Nominal investido
K	Entre barreira de KIKO e limitador	Recebe % Capital protegido + % Variação negativa do ativo
L	Igual ou abaixo do limitador	Recebe % Capital protegido + % Máx. Variação negativa do ativo

3. Classe de Ativos

O COE pode ser referenciado às seguintes classes de ativos:

- 3.1. Ações nacionais e internacionais;
- 3.2. Cesta;
- 3.3. Índices nacionais e índices internacionais;
- 3.4. Índices de preços;
- 3.5. Juros nacionais e internacionais;
- 3.6. Taxas de câmbio;
- 3.7. Títulos públicos e privados;
- 3.8. Commodities nacionais e internacionais.

4. Modalidade

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

- a) *“Perda limitada ao capital investido”* – modalidade na qual o investidor tem a possibilidade de perda parcial, ou total, do capital investido.