

## Certificado de Operações Estruturadas

### COE001083 – COE de Crédito – Troca de Indexadores

#### Descrição:

Neste COE, há a troca do indexador a partir de uma data previamente definida. O valor financeiro de emissão é atualizado por taxa pré ou percentual da taxa DI até a data de troca de indexador. Desta data em diante, ele passa a ser atualizado por uma outra taxa pré ou percentual do DI.

Pode haver previsão de liquidação antecipada deste COE, relacionada à eventos de crédito da entidade/obrigação de referência. Ou seja, caso um ou mais eventos previstos aconteçam, o COE será encerrado antecipadamente conforme a(s) condição(ões) estabelecida(s) na(s) documentação(ões) da emissão.

O investidor(a) pode escolher duas maneiras de remunerar o valor investido, ficando comprado ou vendido, como exposto abaixo.

#### Cenários para o investidor:

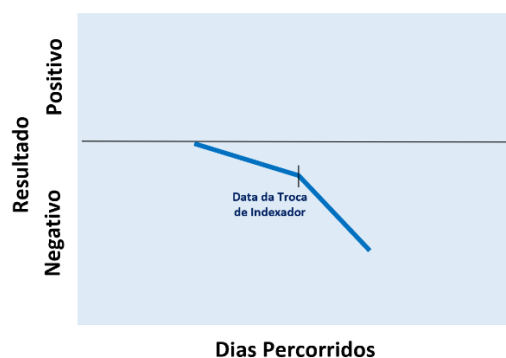
##### **Comprado**

*Troca de Indexadores*



##### **Vendido**

*Troca de Indexadores*



O(a) investidor(a) receberá o valor investido corrigido pelo ativo 1 da data de início até a data de troca de indexadores e pelo ativo 2 da data de troca de indexadores até o vencimento, desde que não ocorra um ou mais eventos de crédito previstos na figura. Na ocorrência de evento de crédito o investidor(a) receberá o maior entre o % capital do capital garantido e o recovery value<sup>1</sup>.

O(a) investidor(a) pagará o valor investido corrigido pelo ativo 1 da data de início até a data de troca de indexadores e pelo ativo 2 da data de troca de indexadores até o vencimento, desde que não ocorra um ou mais eventos de crédito previstos na figura.

Na ocorrência de evento de crédito o investidor(a) pagará o maior entre o % capital do capital garantido e o recovery value<sup>1</sup>.

<sup>1</sup> *Recovery value* = Valor recuperado em decorrência do atingimento de um ou mais eventos de crédito estabelecidos na(s) documentação(ões) da emissão.

### **3. Classe de Ativos**

O COE pode ser referenciado às seguintes classes de ativos:

- 3.1. Títulos públicos
- 3.2. Títulos privados

### **4. Modalidade**

O COE deve ser classificado como:

- a) “Risco de crédito” – modalidade em que o COE é referenciado no risco de crédito de entidade/obrigação de referência.
- b) “Perda limitada ao capital investido” – modalidade em que o investidor tem a possibilidade de perda parcial, ou total, do capital investido.