



DOCUMENTO DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS (“DIE”) – COE
Cesta de Ativos Americanos com Autocall

Descrição do Produto

Objetivo Este COE é indicado para investidores que acreditam que todos os ativos na cesta irão apresentar valorização durante o Prazo de Investimento. O propósito da estrutura é beneficiar-se de um Cupom pré-fixado para qualquer cenário em que o Preço Final observado de todos os ativos da cesta for igual ou maior que 100% de seu Preço Inicial. O investidor terá o capital inicial 100% protegido se a operação for mantida até a Data de Vencimento. Não se trata de Investimento direto nos ativos que compõem o COE.

Resumo dos Termos e Condições Indicativas

Table with 2 columns: Field (Emissor, Prazo de Investimento, Valores, Datas) and Value (Banco BNP Paribas Brasil S.A., 2 anos, Valor Nominal Unitário: R\$ 1,000.00, etc.)

Table with 2 columns: Ativo Objeto and Código Bloomberg (Anheuser-Busch InBev, Coca-Cola Co/The, Tyson Foods, Inc.)

Preço Inicial: Preço de Fechamento do Ativo Objeto na Data de Valoração Inicial.
Preço Final: Preço de Fechamento do Ativo Objeto na Data de Valoração Final.

Estrutura: Local de Registro: CETIP; Nome: Cali Digital (Código CETIP: COE001011); Cupom (intervalo): entre 8.50% e 10.50% ao semestre (Linear); Barreira: 100% do Preço Inicial; Modalidade: Investimento com Valor Nominal Protegido

Proteção de Capital: 100% do Capital Investido, no ultimo dia do Prazo de Investimento.

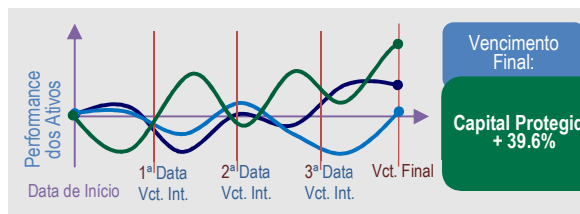
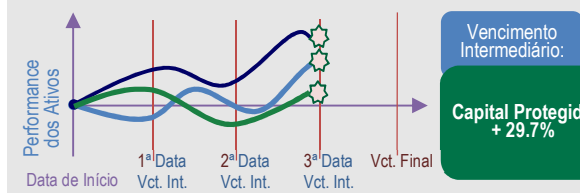
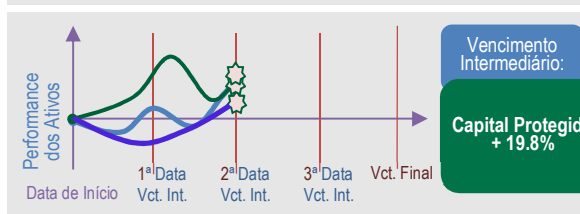
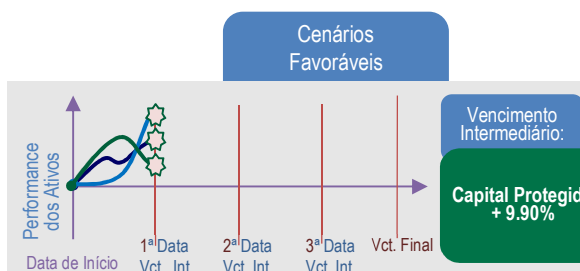
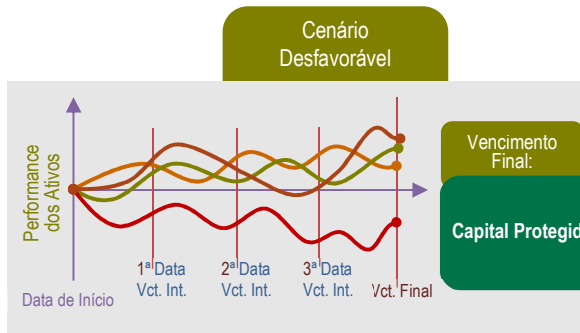
Classificação de Risco: Nível 3

Table with 3 columns: Cenário, Condição, Valor Final no Vencimento. Row 1: Cenário Desfavorável, Caso o Preço de pelo menos um dos ativos da Cesta fique abaixo de 100% do Preço Inicial em todas as Datas de Valoração, Na Data de Vencimento Final, o Investidor receberá o Capital Protegido.

Table with 3 columns: Cenário, Condição, Valor Final no Vencimento. Row 2: Cenários Favoráveis, Caso os Preços de cada um dos ativos da Cesta fiquem iguais ou acima de 100% dos respectivos Preços Iniciais em qualquer Data de Valoração Intermediária, Na respectiva Data de Vencimento Intermediário, a estrutura é resgatada antecipadamente e o Investidor recebe o Capital Protegido acrescido do Cupom proporcional ao período.

Table with 3 columns: Cenário, Condição, Valor Final no Vencimento. Row 3: Cenários Favoráveis, Caso os Preços Finais de cada um dos ativos da Cesta fiquem acima de 100% dos respectivos Preços Iniciais na Data de Valoração Final, Na Data de Vencimento Final, o Investidor recebe o Capital Protegido acrescido do Cupom proporcional ao período.

Cenários



*Estes valores são meramente ilustrativos e não representam o desempenho passado do COE.

**DOCUMENTO DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS (“DIE”) – COE****Cesta de Ativos Americanos com Autocall**

Cenários: Os resultados apresentados nos Cenários acima serão validos exclusivamente se o investimento for mantido até a Data de Vencimento.

Imobilização do Capital Investido: 100% do Valor Nominal protegido, exclusivamente na Data de Vencimento do COE.

Prazo para investimento: O Emissor receberá os investimentos até 15 horas da Data de Início. Qualquer valor recebido após este período será desconsiderado e devolvido ao Investidor.

Liquidez: O Emissor proverá a liquidez do COE por meio das Condições de Recompra e Resgate Antecipados, conforme aqui descrito. Não há informações da liquidez do COE no mercado secundário em razão do COE ser um produto novo no mercado bancário.

Condições de Recompra e Resgate Antecipados: A partir do primeiro Dia Útil posterior à Data de Início as Partes poderão promover o resgate ou a recompra do COE antes da Data de Vencimento, desde que as condições sejam determinadas por mútuo acordo entre o Emissor e o Investidor. O Emissor irá determinar o valor de resgate ou recompra levando em consideração uma série de fatores, incluindo, mas não se limitando: ao valor de mercado, à performance do Ativo Objeto, às taxas e juros vigentes e ao tempo restante até a Data de Vencimento. Nenhuma das Partes se comprometerá a promover o resgate ou a recompra do COE.

Cálculos no vencimento regular e na nos Casos de Liquidação Antecipada. O Emissor será o responsável por realizar o cálculo dos valores devidos na Data de Vencimento ou na Date de Antecipação.

OBRIGAÇÕES DAS PARTES

(a) São obrigações do **Investidor:**

- (i) realizar o investimento inicial mínimo (Valor Nominal Unitário), conforme especificado no presente documento.
- (ii) a cada contratação de COE, manter todas as declarações feitas nos Termo e Condições Investimento em Certificado de Operações Estruturadas - COE, nas respectivas Notas de Negociação, neste DIE e no Termo de Adesão e Ciência de Risco, conforme aplicável, verdadeiras e atualizadas;
- (iii) responsabiliza-se por todas as informações prestadas, eximindo o Emissor de qualquer prejuízo decorrente das informações incorretamente ou inverídicas prestadas; e
- (iv) verificar a adequação do COE ao seu perfil de investimento, segundo suas políticas internas de investimento, se aplicável.

(b) São obrigações do **Emissor:**

- (i) emitir e contabilizar devidamente o COE, conforme as melhores práticas contábeis;
- (ii) fazer com que a Nota de Negociação reflita as informações do COE contratado;
- (iii) registrar o COE no Sistema de Registro;
- (iv) realizar com diligência os cálculos dos valores devidos ao investidor e da remuneração do COE, dentre outros cálculos necessários de acordo com a documentação do COE;

**DOCUMENTO DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS (“DIE”) – COE****Cesta de Ativos Americanos com Autocall****CASOS DE INTERRUPÇÃO DO COE**

A ocorrência, a qualquer tempo, de qualquer de um dos eventos mencionados a seguir, sujeitos aos termos previstos nos Termos Gerais (Conforme definido abaixo) **implicará na interrupção da estratégia** antes da Data de Vencimento. Nesta hipótese não haverá liquidação antecipada do COE e o Investidor receberá os montantes devidos exclusivamente na Data de Vencimento Final.

- (a) **Descontinuidade do Ativo Objeto;**
- (b) **Descontinuidade das Negociações;**
- (c) **Descontinuidade do Hedge;**
- (d) **Encerramento antecipado; e**
- (e) **Alteração na Legislação.**

Para que o Investidor receba o Capital Protegido, será necessário que o Valor Nominal seja Imobilizado até a data de Vencimento Final. Caso ocorra um Evento de Interrupção do COE e o Emissor apure na Data de Vencimento que a estratégia do COE expressa um valor positivo, o Investidor receberá o Capital Protegido, acrescido do referido valor, menos as despesas e perdas incorridas como resultado dos Eventos de Interrupção do COE.

Para entendimento mais aprofundado de como são apurados os evento acima, e suas consequências leia cuidadosamente a clausula “Eventos de Interrupção” dos Termos Gerais.

FATORES DE RISCOS

A aquisição do COE pode implicar nos seguintes riscos:

Risco de Crédito da Instituição Emissora: o recebimento dos montantes devidos pelo Emissor ao Investidor está sujeito ao risco de crédito da instituição emissora. Os investimentos em COE não estão sujeitos ao Fundo Garantidor de Crédito;

Risco de Interrupção do COE: há eventos que podem ensejar na interrupção da estratégia do COE, tais eventos podem impactar o COE de forma adversa, podendo inclusive acarretar em perdas no investimento do respectivo COE. Nos Eventos de Interrupção com relação a um ou mais ativos que compõem o COE durante o prazo de vigência, a liquidação financeira com Valor Nominal Protegido ocorrerá apenas da Data de Vencimento Final, qualquer solicitação de resgate ou recompra antes da referida data acarretará em Risco de perda do valor nominal.

Risco de Mercado: COE é um instrumento financeiro de investimento com estruturas de rentabilidades que apresentam características de instrumentos financeiros derivativos cujos valores de liquidação dependem dos valores dos Ativos Objetos. Desta forma, o COE é um investimento que apresenta risco de mercado. Oscilações dos valores dos Ativos Objetos podem impactar o COE de forma adversa.

Risco de Liquidez: o COE não confere ao Investidor o direito de resgatar antecipadamente os valores investidos, exceto nas hipóteses previstas expressamente neste Documento. Considerando o COE ser um novo ativo financeiro no mercado brasileiro, ainda não há um mercado secundário desenvolvido para sua negociação, o que resulta em baixa liquidez desse tipo de investimento. A referida baixa de liquidez pode acarretar na impossibilidade de venda dos COE ou venda por valores inferiores aos investidos. O Resgate ou a recompra geram risco de perda de valor nominal, ou seja, não garantem o capital protegido.

Risco pela Utilização de Derivativo: instrumentos de derivativos têm sua natureza complexa. O Investidor deve se assegurar que leu e compreendeu todos os termos e utilizações deste produto e que tal produto se adequa ao seu perfil de Investidor.

**DOCUMENTO DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS (“DIE”) – COE****Cesta de Ativos Americanos com Autocall**

Risco de Perda de Valor Nominal: no caso do COE classificado como investimento com valor nominal protegido, o pagamento do valor nominal investido somente será assegurado considerando-se a soma de todos os valores pagos em relação aos COE, desde a Data de Início até a Data de Vencimento (inclusive), não sendo portanto o recebimento do valor nominal nas hipóteses de resgate antecipado, recompra ou negociações do COE em mercado secundário. No caso de COE classificado como Investimento com Nominal em Risco, o valor investido pode ser total ou parcialmente perdido, sendo que qualquer recebimento do valor inicialmente investido somente será assegurado com relação à parcela previamente acordada, considerando-se também a soma de todos os valores pagos em relação ao COE desde a Data de Início até a Data de Vencimento (inclusive).

Risco de Registro: quaisquer falhas relacionadas ao registro do COE no Sistema de Registro aplicável, inclusive falhas operacionais, podem causar impactos adversos nos pagamentos previstos no COE.

Risco de Alteração da Legislação Tributária: os impostos, taxas, contribuições e encargos que incidam ou venham a incidir no futuro sobre as aplicações em COE serão suportados exclusivamente pelo Investidor. Quaisquer alterações na legislação e regulamentação vigente, inclusive para majoração das alíquotas vigentes, serão suportadas pelo Investidor.

DISPOSIÇÕES GERAIS

- (a) **Anuência ao DIE e aos Termos e Condições Investimento em Certificado de Operações Estruturadas - COE.** Ao realizar o Investimento Inicial Mínimo e assinar o Termo de Adesão Ciência e Risco o Investidor estará aderindo de forma irrevogável e irretroatável aos termos do presente DIE, bem como aos Termos e Condições Investimento em Certificado de Operações Estruturadas - COE (“**Termos Gerais**”), obrigando-se a cumpri-los integralmente.
- (b) **Definições:** Os termos utilizados em letra maiúscula e não definidos no presente instrumento, possuirão seu significado nos Termos Gerais, disponível no www.bnpparibas.com.br.
- (c) **Outras Operações do Emissor:** o Emissor, no curso normal de suas atividades, atua de forma relevante nos mercados de derivativos em geral, bem como nos mercados em que são negociados índices, taxas, preços, condições, direitos e ativos referenciais dos COE, fazendo, inclusive, operações de proteção (hedge) de suas posições por meio de outras operações contratadas em tais mercados. Desta forma, declara que está ciente de que tais operações praticadas pelo Emissor podem afetar, direta ou indiretamente, os resultados oriundos do COE.

**DOCUMENTO DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS (“DIE”) – COE**
Cesta de Ativos Americanos com Autocall

ESTE DOCUMENTO FOI PREPARADO COM AS INFORMAÇÕES NECESSÁRIAS AO ATENDIMENTO DAS MELHORES PRÁTICAS DE MERCADO ESTABELECIDAS PELO CÓDIGO ANBIMA DE REGULAÇÃO E MELHORES PRÁTICAS DE NEGOCIAÇÃO DE INSTRUMENTOS FINANCEIROS;

O RECEBIMENTO DOS PAGAMENTOS DO CERTIFICADO ESTÁ SUJEITO AO RISCO DE CRÉDITO DO SEU EMISSOR;

O CERTIFICADO NÃO CONTA COM GARANTIA DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO – FGC;

A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS;

AS INFORMAÇÕES PRESENTES NESTE MATERIAL SÃO BASEADAS EM SIMULAÇÕES E OS RESULTADOS REAIS PODERÃO SER DIFERENTES;

A DISPONIBILIZAÇÃO DESTA DOCUMENTO NÃO IMPLICA, POR PARTE DA ANBIMA, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS, OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO COE OU DE SEU EMISSOR; e

A PRESENTE OFERTA FOI DISPENSADA DE REGISTRO PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS- CVM. A DISTRIBUIÇÃO DE CERTIFICADO DE OPERAÇÃO ESTRUTURADA – COE NÃO IMPLICA, POR PARTE DOS ÓRGÃOS REGULADORES VIGENTE, GARANTIA DE VERACIDADE DAS INFORMAÇÕES PRESTADAS OU DE ADEQUAÇÃO DO CERTIFICADO À LEGISLAÇÃO VIGENTE OU JULGAMENTO SOBRE A QUALIDADE DO EMISSOR OU DA INSTITUIÇÃO INTERMEDIÁRIA.

Ouvidoria Banco BNP Paribas Brasil S/A.: Av. Juscelino Kubitschek, nº 510, 13º andar, CEP 04543-906, São Paulo, SP.
Horário de Atendimento: de segunda à sexta-feira, das 9:00 às 18:00 horas. Telefone: 0800-7715999. E-mail: Ouvidoria@br.bnpparibas.com. Internet: www.bnpparibas.com.br - Ouvidoria.