
A blue-tinted photograph of a pen writing on a grid with a line graph. The pen is in the foreground, angled from the bottom left towards the top right. The background shows a grid with a line graph that has several peaks and valleys. The overall image has a soft, slightly blurred quality.

Manual de Operações

COE - Certificado de Operações Estruturadas

Versão: 20/09/2021

Atualização: 20/09/2021

[B]³

Conteúdo

Atualizações da Versão	4
Introdução ao COE	14
Conhecendo o Módulo	15
Serviço de Atendimento ao Mercado	16
Ações dos botões das telas	17
Lançamentos	18
Registro/Emissão	19
Fluxo de Caixa	36
Marcação à Mercado	41
Operação de Depósito	43
Resgate Antecipado	48
Compra/Venda Definitiva/Cessão	51
Bloqueio/Desbloqueio de Custódia	55
Cancelamento de Operação	58
Atualização de PU.....	59
Indicação de Disparo de Trigger	72
Atualização de Valores de Notional (“Análise de Sensibilidade”).....	74
Garantia	76
Cancelamento Retroativo de Operação de Depósito.....	78
Indicação de Entrega Física.....	79
Manutenção do Código ISIN	81
Parametrização de Cestas	82
Indicação de Pagamento Extraordinário.....	87
Lançamento de Datas para Fixing (Mais Datas).....	89
Vinculação de Reserva Técnica	91
Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica	93
Consultas	96
Consulta de Marcação a Mercado.....	97
Consulta COE	98
Consulta de Ativo Subjacente	102
Consulta de Notional Máximo e Mínimo (“Análise de Sensibilidade”).....	103
Consulta de Agenda Fluxo de Caixa COE	104
Pendências de Marcação a Mercado e Sensibilidade	106
Consulta Cesta	107

Consulta de Operações de Atualização de PU.....	108
Consulta de “Mais Datas” para Fixing	109
Informações Adicionais	110
Ativos x Naturezas Econômicas	111
Anexo – Descrição dos campos das figuras.....	112
Operação de intermediação no mercado primário para COE	298
COE Simplificado	299
Transferência de IF sem Financeiro	300
Ativos subjacentes	301
Funcionalidade.....	306
Cestas.....	308

Atualizações da Versão

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
20/09/2021	20/09/2021	Atualização de PU: Valor Inicial do Ativo Subjacente e Ajuste Valor Referência	Atualização do Ajuste Valor Referência (Atualização de PU) em até D+3 do registro e inclusão do campo "Quantidade 1" nos tipos de atualização de PU: 1. Valor Inicial Ativo Subjacente e 2. Ajuste Valor Referência, conforme divulgado no comunicado 049/2021 VPC
30/07/2021	30/07/2021	Registro/Emissão	Inclusão do novo domínio "PRÉ LIN/360 + VC USD" no campo " Campo Remunerador no Vencimento".
10/05/2021	10/05/2021	Alteração de nome de campo	Alteração do label do campo "Instrução CVM 569" para "Resolução CVM 8", conforme divulgado no comunicado 009/2021 VPC
28/09/2020	29/04/2021	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão das figuras: COE 001059 – CCall KO Cond + VPut KI Double Bkt; COE 001060 – CCallSpread + VPutSpread 001061 – CCall + VPutSpread e COE
28/09/2020	12/02/2021	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura: COE 001058 – Put KI + Callspread.
28/09/2020	18/11/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão do campo "Remunerador Adicional" na figura – COE001013 - Double Digital.
28/09/2020	18/11/2020	Registro/Emissão	Inclusão de domínio no campo "Condição Específica de Resgate"
28/09/2020	04/11/2020	Descrição dos campos das figuras	Alteração na descrição do campo "Rebate no Cenário de Baixa (%)" da figura COE001004 – Put KO
28/09/2020	28/09/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Alteração da Descrição da figura " COE001046 – CallSpread + Call KO " no campo "Quantidade 1" e "Quantidade 2".
28/09/2020	28/09/2020	Inclusões referentes ao projeto de melhorias do COE	Inclusão do campo Remunerador para Fluxo de Caixa, Funcionalidades, Novos tipos de Cestas, Cláusula de Resgate pelo Emissor, inclusão de Mais Datas para Fixing. Inclusão de Barreira de Cupom 2 e Barreira de Chamada 2, campo Tipo de Fixing 021/2020-VPC
28/09/2020	28/09/2020	Compra/Venda Definitiva/Cessão e Resgate Antecipado	Inclusão dos campos "Posição Origem – Bloqueio Judicial" e "Num. Cetip Op. Original – Bloqueio Judicial" para realização da Operações de ativos que estejam em posição de Bloqueio Judicial, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC
28/09/2020	28/09/2020	Operação de Depósito	Inclusão do campo "Depósito em Posição de Bloqueio Judicial" para realização da Operação de Depósito sem Financeiro diretamente em posição de Bloqueio Judicial, conforme divulgado no comunicado 024/2020-VPC.
29/06/2020	24/09/2020	Registro/Emissão	Atualização das informações sobre o campo " Proteção contra Proventos "
29/06/2020	01/09/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura: COE 001057 – Retorno Condicional 2

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
29/06/2020	12/08/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura: COE001056 – Double Call KO + CallSpread.
29/06/2020	14/07/2020	Ativos Subjacentes	Inclusão do Ativo Subjacente Memória Alavancada (“MA”)
29/06/2020	29/06/2020	Bloqueio/Desbloqueio de Custódia	Inclusão dos campos “Número do Processo” e “Vara”, conforme divulgados nos comunicados 004/2020 e 019/2020-VPC.
17/02/2020	18/05/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura: COE001055 – CCallSpread + VPutSpread + VPut
17/02/2020	08/05/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura: COE001054 – Alocação Forwards KI
17/02/2020	09/04/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Alteração na descrição do campo “ Strike 2(%) ” da figura COE001046 – CallSpread +Call KO
17/02/2020	06/04/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura: COE001053 – Retorno Condicional
17/02/2020	06/04/2020	Registro/Emissão	Alteração na descrição dos campos: Posição do emissor no derivativo; Resgate Antecipado e Condição Específica de Resgate
17/02/2020	12/03/2020	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão das figuras: Figura COE 001051 – Call Spread KI + Put; Figura COE 001052 – C Call + C Put KO + V PS KI
17/02/2020	27/02/2020	Ativos Subjacentes	Atualização do alinhamento feito para o COE – Memória Base.
17/02/2020	17/02/2020	- Consulta de Agenda Fluxo de Caixa COE - Consulta Cesta	Inclusão do “ Detentor ” para consulta das características de Cestas e Fluxo de Caixa COE, conforme divulgado no comunicado 002/2020-VPC.
17/02/2020	17/02/2020	Indicação de Pagamento Extraordinário	Inclusão das seguintes classes de ativos subjacente: Índices; Índices Internacionais e Taxas de Câmbio, conforme divulgado no comunicado 002/2020-VPC.
17/02/2020	17/02/2020	Registro/Emissão	Inclusão das seguintes classes de ativos subjacente: Índices; Índices Internacionais e Taxas de Câmbio, no campo “ Pagamento Extraordinário ”, conforme divulgado no comunicado 002/2020-VPC.
25/03/2019	21/11/2019	Ativos Subjacentes	Inclusão de novos ativos na Tabela 6 “ Ativos Subjacentes 43 ”
25/03/2019	25/10/2019	Atualização de PU	Alteração da “Tela Atualização Remunerador”
25/03/2019	17/10/2019	Registro/Emissão	Ajuste na descrição dos campos “Remunerador Flutuante (%)” e “Spread/Cupom (%)”
25/03/2019	10/09/2019	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Alteração da Descrição da figura “COE001009 - Straddle Put KO” no campo “Rebate no Cenário de Baixa (%)”
25/03/2019	30/08/2019	Atualização de PU	Substituição das telas “Atualização de PU de um COE” e “Atualização Valor Inicial Ativo Subjacente”
25/03/2019	16/08/2019	Registro/Emissão	Alteração da descrição do campo “Proteção Contra Proventos”
25/03/2019	09/08/2019	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão de descrição do Ativo Subjacente 50.
25/03/2019	18/06/2019	Ativos subjacentes	Inclusão do Ativo Subjacente ENHAEMOK_WP.
25/03/2019	28/03/2019	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão de descrição do Ativo Subjacente 49.

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
25/03/2019	25/03/2019	Registro/Emissão	Alteração da descrição dos campos “Tipo de Regime” e “Conta do Escriturador” de acordo com o comunicado 002/2018 – VPC, 007/2018 – VPC, 016/2018 - VPC
25/03/2019	25/03/2019	Consulta COE	Atualização de tela de acordo com o comunicado 002/2018 – VPC, 007/2018 – VPC, 016/2018 – VPC
25/03/2019	25/03/2019	Garantia Compra e Venda Definitiva/Cessão	Retirada da regra de necessidade do Custodiante do Investidor ser autorizado pela CMV.
25/03/2019	25/03/2019	Todo o Manual	Melhoria da descrição.
11/09/2018	15/03/2019	Ativos Subjacentes	Melhoria de descrição de Ativos Subjacentes Watermark Performance.
11/09/2018	11/03/2019	Todo Manual	Melhoria de descrição das funções e campos.
11/09/2018	21/01/2019	Fluxo de Caixa	Alteração da descrição do campo “Data”
11/09/2018	21/01/2019	Ativos subjacentes	Inclusão do Ativo Subjacente Watermark Performance e Performance Acumulada (“PA”)
11/09/2018	26/12/2018	Ativos subjacentes	Correção de formatação e inclusão de descrição do Ativo Subjacente 43.
11/09/2018	05/12/2018	Consulta de Ativo Subjacente	Correção do caminho para a função
11/09/2018	21/11/2018	Indicação de Pagamento Extraordinário	Alteração da descrição do Fator Evento Extraordinário.
11/09/2018	14/11/2018	Fluxo de Caixa	Inclusão de USD VCP na descrição de Spread/Cupom (%).
11/09/2018	10/10/2018	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da Figura COE 001048
11/09/2018	10/10/2018	Fluxo de Caixa	Correção da descrição dos campos “Condicionante de Barreira Cupom (%)” e “Condicionante de Barreira Chamada (%)”
11/09/2017	20/08/2018	Ativos Subjacentes	Inclusão dos Ativos subjacentes rainbow
11/09/2017	06/06/2018	Ativos Subjacentes	Inclusão dos Ativos subjacentes com memória.
11/09/2017	09/05/2018	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura COE 001047
11/09/2017	21/02/2018	Ativos subjacentes	Inclusão de Índices Proprietários.
11/09/2017	04/01/2018	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Correção da descrição do campo “Participação Indexador 1 (%)” da figura COE 001045.
11/09/2017	11/12/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Melhoria da descrição dos campos da figura COE 001045.
11/09/2017	27/11/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Melhoria da descrição dos campos Data Inicial para verificação e Data final para verificação da figura COE 001042. E inclusão do campo Quantidade 2 para COE001014.
11/09/2017	06/10/2017	Transferência de IF sem Financeiro	Melhoria da descrição da função.
11/09/2017	26/09/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da nova figura COE 001046
11/09/2017	20/09/2017	Consulta de Ativo Subjacente	Exclusão do arquivo.
11/09/2017	12/09/2017	Ativos subjacentes Consulta de Ativo Subjacente	Inclusão dos arquivos.
11/09/2017	11/09/2017	Atualização de PU	Melhoria da descrição da visão geral de acordo com o comunicado 038/17.
11/09/2017	11/09/2017	Registro/Emissão	Inclusão do campo “Condição Específica de Resgate” e melhoria da descrição do campo “Resgate Antecipado” de acordo com o comunicado 038/17.

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
31/07/2017	01/09/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da nova figura COE 001045.
31/07/2017	30/08/2017	Registro/Emissão	Atualização da descrição do campo proteção contra proventos.
31/07/2017	03/08/2017	Resgate Antecipado	Atualização da tela e inclusão de observação.
31/07/2017	31/07/2017	Consulta COE	Alteração da tela de consulta conforme o comunicado 038/17.
31/07/2017	31/07/2017	Registro/Emissão	Alteração do nome do campo Regime de Depósito para Tipo de Regime. Melhoria da descrição do campo Conta Escriturador e Tipo de Regime conforme o comunicado 038/17.
31/07/2017	31/07/2017	Registro/Emissão	Alteração na Tela Registro/Emissão do Certificado de Operações estruturada e melhoria na descrição do campo “Fluxo de Caixa” conforme o comunicado 038/17.
31/07/2017	31/07/2017	Registro/Emissão	Alteração da Tela Registro Fluxo de Caixa – COE e melhoria na descrição “Memória de Cupom” conforme o comunicado 023/17.
31/07/2017	31/07/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão do campo “Quantidade 1” e melhoria da descrição “Opções dependentes” conforme o comunicado 023/17.
29/05/2017	12/07/2017	Transferência de IF sem Financeiro	Inclusão do tópico.
29/05/2017	03/07/2017	Registro/Emissão	Melhoria na descrição do campo “Proteção contra proventos”
29/05/2017	08/06/2017	Registro/Emissão	Melhoria na descrição do campo Variação Quanto.
29/05/2017	29/05/2017	Atualização de PU	PU para COE simplificado – Inclusão da informação referente ao remunerador VCP. Atualização Ajuste Valor Referência – Inclusão da tela com cesta.
21/11/2016	11/04/2017	Registro/Emissão	Melhoria na descrição dos Campos que podem ser alterados pelo participante.
21/11/2016	06/04/2017	Atualização de PU	Atualização dos tipos/motivos de atualização
21/11/2016	13/03/2017	COE Simplificado	Inclusão do arquivo.
21/11/2016	13/03/2017	Tratamento de Proventos	Exclusão do arquivo.
21/11/2016	13/03/2017	Indicação de Disparo de Trigger	Melhoria da descrição das premissas da Visão Geral.
21/11/2016	13/03/2017	Atualização de PU	Melhoria da descrição dos tipos/motivos de atualização da Visão Geral. Alteração da descrição do campo Tipo de Atualização e do campo Data da Atualização. Exclusão da Observação da Tela Atualização Ajuste Valor Referência e Inclusão da Observação da Tela Atualização Valores Lookback.
21/11/2016	10/03/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Melhoria na formatação da descrição de registro da figura COE001041 Wedding Cake.
21/11/2016	09/03/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Atualização das instruções de registro da figura COE001041 Wedding Cake.
21/11/2016	22/02/2017	Registro/Emissão	Melhoria na formatação do campo Data Final de Lookback.
21/11/2016	13/02/2017	Registro/Emissão	Melhoria do campo Data Final de Lookback.
21/11/2016	13/02/2017	Atualização de PU	Inclusão da Observação.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
21/11/2016	13/02/2017	Pendências de Marcação a Mercado e Sensibilidade	Inclusão de informações na Visão Geral referente à Resolução 4.263.
21/11/2016	01/02/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Correção no campo “Período de verificação de barreiras” da figura 42 e ajuste na descrição do campo “Barreira(%)” da figura 43.
21/11/2016	04/01/2017	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Alteração da Observação da figura COE 001044 – Podium
21/11/2016	29/12/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Mudança do nome “Remunerador adicional para Remuneração adicional” da figura COE001041 e do “Tipo de Remunerador Adicional para Remuneração adicional” da figura COE 001044; Exclusão dos campos nas informações referentes a Call KO2. Exclusão dos dados específicos da Figura COE 001043.
21/11/2016	29/12/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Exclusão da “Tabela de Remunerador Adicional por figura do COE”.
21/11/2016	29/12/2016	Procedimentos Especiais para Liquidação Financeira	Exclusão do arquivo “Procedimentos Especiais para Liquidação Financeira”
21/11/2016	29/12/2016	Parametrização de Cestas	Alteração da descrição de “Data Fixing Paridade”
21/11/2016	29/12/2016	Registro/Emissão	Alteração da descrição de “Data Fixing Paridade Não Quanto”
21/11/2016	22/12/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura “Figura COE 001043 – Edge Accrual”. Inclusão de informação no campo “Barreira(%)”.
21/11/2016	16/12/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura “Figura COE 001044 – Podium”.
21/11/2016	28/11/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura “Figura COE 001043 – Edge Accrual” e ajuste da figura “Figura COE 001042 – Call KO1 + Call KO2”.
21/11/2016	24/11/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura “Figura COE 001042 – Call KO1 + Call KO2”
21/11/2016	24/11/2016	Atualização de PU	Alteração da descrição do campo “Data de Atualização” de “em até D+1 ao dia do registro” para “em todas as datas”.
21/11/2016	21/11/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Alteração na descrição do campo “Quantidade 1” e “Quantidade 2” do texto “Campo de preenchimento obrigatório” para preenchimento opcional.
27/05/2016	03/11/2016	Registro/Emissão	Correção da descrição do campo Remunerador Flutuante (%) e Spread/Cupom (%).
27/05/2016	27/10/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	alteração na descrição do campo “Remunerador Flutuante Camada 3” da Figura COE001041 – Wedding Cake
27/05/2016	20/10/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Alteração no Campo de Domínio Produção para a Figura “COE001025 - Double No Touch” e “COE001026 - One Touch”
27/05/2016	14/10/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão dos campos “Período de Verificação de barreiras”; “Data Inicial para verificação”; e “Data final para verificação” na figura COE001041 – Wedding Cake.

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
27/05/2016	07/10/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Alteração da descrição dos campos Rebate no Cenário de Baixa (%) e Rebate no Cenário de Alta (%) do registro da figura COE001010 - Straddle KO Call_Put
27/05/2016	22/09/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão dos campos Remunerador Flutuante Dentro (%) e Remunerador Flutuante Fora (%) referente a Figura COE001013 - Double Digital.
27/05/2016	14/07/2016	Tabela de Remunerador Adicional por figura do COE	Atualização na tabela do tipo de remunerador adicional: "NO PERIODO" para as figuras Digital Call e Digital Put.
27/05/2016	11/07/2016	Anexo – Descrição dos campos das figura	Na figura COE001025, melhoria na descrição dos campos Data Inicial para Verificação e Data Final para Verificação.
27/05/2016	27/05/2016	Resgate Antecipado	Possibilidade de resgate antecipado entre emissor e conta cliente (10) de terceiros, conforme comunicado 046/16.
21/03/2016	06/05/2016	Registro/Emissão	Alteração na descrição do campo "Regime de Depósito".
21/03/2016	05/05/2016	Registro/Emissão	Alteração na descrição do campo "Conta do Escriturador".
21/03/2016	05/05/2016	Depósito	Inclusão do distribuidor no texto de Opção II: Depósito com financeiro de COE de distribuição pública.
21/03/2016	05/05/2016	Resgate Antecipado	Inclusão do texto sobre após tela de resgate antecipado.
21/03/2016	05/05/2016	Compra/Venda Definitiva/Cessão	Alteração na descrição do campo "Papel".
21/03/2016	25/04/2016	Registro/Emissão	Alteração na descrição do campo "Valor Inicial do Ativo Subjacente".
21/03/2016	24/03/2016	Registro/Emissão	Inclusão das informações sobre ofertas públicas ICVM 400, ICVM476 e ICVM569 na Visão Geral.
21/03/2016	21/03/2016	Registro/Emissão Indicação de Pagamento Extraordinário Consulta COE	Disponibilização do campo e da função Indicação de Pagamento Extraordinário, conforme comunicado 003/16.
21/03/2016	21/03/2016	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Inclusão dos campos: Quantidade 1 e Quantidade 2 nas figuras com dois Strikes. COE001016; COE001017; COE001018; COE001019; COE001027; e COE001035.
25/01/2016	16/03/2016	Depósito	Exclusão do tipo conta 69 na descrição do campo Parte.
25/01/2016	29/02/2016	Resgate Antecipado	Melhoria no texto da Visão Geral.
25/01/2016	29/02/2016	Retirada	Alteração na descrição do campo "Reserva Técnica".
25/01/2016	29/02/2016	Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica	Melhoria no texto da Visão Geral e exclusão da observação 4).
25/01/2016	26/02/2016	Consulta de Ativos Subjacentes com Cotação Pendente	Exclusão da consulta.
25/01/2016	28/01/2016	Tratamento de Proventos	Inclusão do novo tópico.
25/01/2016	28/01/2016	Operação de intermediação no mercado primário para COE	Inclusão das novas figuras COE001039 – Call Spread + Put Spread e COE001040 – Put Spread + Put Spread.
25/01/2016	25/01/2016	Operação de intermediação no mercado primário para COE	Inclusão da nova figura COE001041 – Wedding Cake.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
25/01/2016	25/01/2016	Registro/Emissão	Inclusão dos campos “Descrição Entrega Física” e “Regime de Depósito” e alteração do nome Oferta Pública para Instrução CVM 569.
25/01/2016	25/01/2016	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão do domínio produção “NO PERÍODO” para as seguintes figuras: COE001025 e COE001026 na Tabela de Remunerador Adicional por figura do COE.
23/11/2015	13/01/2016	Fluxo de Caixa	Não é permitido inserir números negativos no campo “Spread/Cupom (%)”.
23/11/2015	13/01/2016	Registro/Emissão	Não é permitido inserir números negativos no campo “Spread/Cupom (%)”.
23/11/2015	12/01/2016	Registro/Emissão	Inclusão do texto: “Caso a classe do ativo subjacente selecionada for CESTA, este campo não deverá ser preenchido. O sistema adotará 10.000 como valor inicial do ativo subjacente”, na descrição do campo Valor inicial do ativo subjacente.
23/11/2015	23/11/2015	Compra/Venda Definitiva/Cessão	Melhoria no texto da Visão Geral.
27/07/2015	29/10/2015	Registro/Emissão - Ação Incluir	Disponibilização dos índices “IBOVESPA” no campo Remunerador, “No Período” no campo Spread/Cupom (%) e inclusão do texto “Não preencher se remunerador indicado for No Período” no campo Base.
27/07/2015	24/08/2015	Depósito	Inclusão do texto “O depósito de COE de distribuição pública somente é admitido para contas que possuam Custodiante do Investidor autorizado pela CVM indicado”.
27/07/2015	17/08/2015	Utilização de “Cesta” como Ativo Subjacente	Exclusão do tópico.
27/07/2015	10/08/2015	Atualização de PU	Alteração na descrição do campo “Fator de Correção de Remunerador”.
27/07/2015	03/08/2015	Cancelamento de Operação	Inclusão da frase na Visão Geral: Para lançamento de PU na a operação de resgate, finalizada na sem modalidade o cancelamento não será permitido.
27/07/2015	27/07/2015	Manutenção de Código ISIN	Inclusão do tópico.
27/07/2015	27/07/2015	Garantia	Inclusão de informação sobre situações em que é obrigatório Custodiante do Investidor.
27/07/2015	27/07/2015	Compra/Venda definitiva/Cessão	Inclusão de informação sobre situações em que é obrigatório Custodiante do Investidor.
27/07/2015	27/07/2015	Depósito	Inclusão da informação sobre os responsáveis pelo lançamento e inclusão de informação sobre situações em que é obrigatório Custodiante do Investidor.
27/07/2015	27/07/2015	Registro de COE	Melhoria na descrição do campo “Conta do Escriturador”.
27/07/2015	27/07/2015	Parametrização de Cestas e Fluxo de Caixa	Disponibilização da cesta e fluxo de caixa, conforme comunicados 015/15 e 032/15.
18/05/2015	07/07/2015	Utilização de “Cesta” como Ativo Subjacente	Inclusão da cesta SPREAD_03
18/05/2015	01/07/2015	Registro/Emissão	Melhoria na descrição no campo Remunerador Flutuante%.
18/05/2015	01/06/2015	Atualização de PU	Inclusão da opção “Ajuste Valor Referência” na Visão Geral.

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
18/05/2015	25/05/2015	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão da figura COE001038 - Double One Touch
18/05/2015	18/05/2015	Marcação a Mercado	A informação de atualização do MtM dos COEs deve ser baseada na Quantidade em Estoque.
18/05/2015	18/05/2015	Registro/Emissão	Disponibilização do campo “Entrega Física” apenas para as classes Ações e Títulos Privados .
18/05/2015	18/05/2015	Atualização de PU	Disponibilização da opção “Ajuste Valor Referência”.
18/05/2015	18/05/2015	Consulta COE	Disponibilização da coluna “Código Identificador”, conforme comunicado 036/15.
18/05/2015	18/05/2015	Indicação de Entrega Física	Disponibilização da função.
23/02/2015	06/05/2015	Indicação de Disparo de Trigger	Na Visão Geral inclusão da observação.
23/02/2015	29/04/2015	Utilização de “Cesta” como Ativo Subjacente	Exclusão das cestas STANDARD01 e STANDARD02 . Inclusão das cestas STANDARD05 e STANDARD06 .
23/02/2015	13/04/2015	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Acerto no formato do campo “Limitador Cenário de alta (%)”, nas figuras 1036 e 1037.
23/02/2015	01/04/2015	Utilização de “Cesta” como Ativo Subjacente	Inclusão da cesta STANDARD04 .
23/02/2015	30/03/2015	Registro/Emissão	Mudança na descrição do campo “Proteção contra Proventos”.
23/02/2015	10/03/2015	Anexo – Descrição dos campos das figuras	Inclusão das figuras: COE001036 – Fence e COE001037 – Fence KI CallSpread .
23/02/2015	10/03/2015	Atualização de PU	Inclusão das telas para: Cotação para Fixing, PU para Knock-out no ATO e Fator Path Dependent.
23/02/2015	02/03/2015	Registro/Emissão	É de responsabilidade do emissor que o depósito do COE seja feito na mesma data da emissão.
23/02/2015	27/02/2015	Utilização de “Cesta” como Ativo Subjacente	Inclusão da cesta STANDARD03 .
23/02/2015	23/02/2015	Garantia	Inclusão dos campos CPF/CNPJ (Cliente) e Natureza (Cliente).
23/02/2015	23/02/2015	Registro/Emissão	Inclusão do remunerador “NO PERÍODO” para qualquer figura do COE, no campo “Remunerador”, conforme comunicado 014/15.
19/01/2015	20/02/2015	Registro/Emissão	Na Visão Geral, inclusão das observações 2 e 3.
19/01/2015	09/02/2015	Garantia	Inclusão da função.
19/01/2015	29/01/2015	Utilização de “Cesta” como Ativo Subjacente	Criação de uma nova cesta (Standard02).
19/01/2015	26/01/2015	Utilização da “Cesta” como Ativo Subjacente	Atualização das Cestas.
19/01/2015	19/01/2015	Registro/Emissão	Possibilidade do Limitador Cenário de Baixa % ser igual a zero.
20/10/2014	12/11/2014	Registro/Emissão	COE com Entrega Física: “Exclusivo para COE alienado pelo Emissor, para seu Cliente (1 ou 2).”.
20/10/2014	30/10/2014	Atualizações da Versão	Mudança de lugar no manual e mudança na ordem cronológica. Da mais recente para a mais antiga.
20/10/2014	20/10/2014	Registro de COE e Atualização de PU	Inclusão dos remuneradores IBOVSPA VCP, USD VCP e USD.
20/10/2014	20/10/2014	Registro do COE	Exclusão das restrições nos campos de Remunerador do COE.

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
15/09/2014	15/10/2014	Cancelamento Retroativo de Depósito.	Inclusão da função.
15/09/2014	15/10/2014	Utilização de "Cesta" como Ativo Subjacente	Criação de uma nova cesta (WRST_OF_05)
15/09/2014	24/09/2014	Dados Específicos – COE001011 Digital Call e COE001012 - Digital Put	Melhoria na descrição do campo Remuneração Adicional.
15/09/2014	15/09/2014	Registro/Emissão	Inclusão do campo Entrega Física, conforme comunicado 081/14.
07/07/2014	12/09/2014	Marcação a Mercado	Em Visão Geral inclusão da frase: "O valor da marcação a mercado deve ser informado na visão do Emissor (Débito)".
07/07/2014	12/09/2014	Atualização PU	Mudança da Tela Atualização Remunerador Renda Fixa para Atualização Remunerador.
07/07/2014	04/09/2014	Marcação a Mercado	Melhoria na descrição do campo Sinal.
07/07/2014	02/09/2014	Todo o manual	Nas descrições dos campos, inclusão da informação se o preenchimento é obrigatório ou não.
07/07/2014	11/08/2014	Registro/Emissão	No campo Descrição Remunerador, mudança de 100 para 300 caracteres.
07/07/2014	11/08/2014	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Mudança de 4 decimais para 8 decimais nos seguintes campos: Strike 1 (%), Strike 2 (%), Barreira no Cenário de Alta (%), Barreira no Cenário de Baixa (%), Limitador Cenário de Alta (%), Limitador Cenário de Baixa (%), Barreira KO (%), Barreira KI (%), Barreira KIKO e Barreira (%).
07/07/2014	23/07/2014	Descrição Remunerador	Tamanho do campo
07/07/2014	11/07/2014	Registro/Emissão	O sistema permite o registro de resgate retroativo de COE, no prazo de até de D-2 da data do sistema.
07/07/2014	07/07/2014	Registro/Emissão	Inclusão do campo Conta Escriturador.
07/07/2014	07/07/2014	Operação de intermediação no mercado primário para COE	Inclusão da Informação Adicional.
23/06/2014	23/06/2014	Campo Remunerador Dentro e Remunerador Fora	Retirada do trecho "maior que zero".
02/06/2014	02/06/2014	Registro/Emissão	Inclusão do campo Código Identificador. Conforme comunicado 036/14.
02/06/2014	02/06/2014	Atualização de PU	Inclusão do Tipo de Atualização Fator Path Dependent. Conforme comunicado 036/14.
02/06/2014	02/06/2014	Atualização de Valores de Notional	Inclusão do campo Data Refer. Atualização. Conforme comunicado 036/14.
02/06/2014	02/06/2014	Consulta de Ativos Subjacentes com Cotação Pendente	Mudança no parâmetro da pesquisa.
06/01/2014	08/01/2014	Indicação de Disparo de Trigger	Mudança de nomenclatura e tela.
06/01/2014	22/05/2014	Depósito	Inclusão da observação quanto ao prazo para depósito do COE.
06/01/2014	12/05/2014	Registo e Emissão	No campo Código IF acréscimo de informação na descrição.
06/01/2014	23/04/2014	Atualização de "Cesta" como Ativo Subjacente	Peso % De: 100 Para: 100,00000000
06/01/2014	22/04/2014	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Inclusão da Tabela de Remunerador Adicional
06/01/2014	14/04/2014	Atualização de "Cesta" como Ativo Subjacente	Inclusão de cesta.

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
06/01/2014	31/03/2014	Atualização de PU	Na Visão Geral, exclusão da observação.
06/01/2014	25/03/2014	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Inclusão dos campos específicos à nova figura – COE001035 – VPutDigital + CCallDigital + CallSpread.
06/01/2014	25/03/2014	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Melhoria no texto de algumas descrições.
06/01/2014	21/03/2014	Depósito e Retirada	Mudança no texto da Visão Geral
06/01/2014	21/03/2014	Conhecendo o produto	Mudança no texto.
06/01/2014	19/03/2014	Introdução ao COE	Inclusão do tópico Serviço de Atendimento ao Mercado.
06/01/2014	19/03/2014	Lançamentos – Atualização de PU (MtM)	Na Visão Geral, inclusão da observação.
06/01/2014	19/03/2014	Lançamentos – Atualização dos Valores de Notional	Inclusão do termo Análise de Sensibilidade.
06/01/2014	19/03/2014	Informações Adicionais	Inclusão do tópico “Cesta” como Ativo Subjacente.
06/01/2014	11/03/2014	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Inclusão dos campos específicos as nova figuras – COE001033 – Participation Forward Limitadores e COE001034 – Participation Forward Flex II.
06/01/2014	17/02/2014	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Nos campos “Remunerador Flutuante Adicional (%)” inclusão da frase “Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.”.
06/01/2014	05/02/2014	Atualização dos Valores de Notional.	Inclusão da descrição dos campos da tela Registro de Valores de Notional.
06/01/2014	30/01/2014	Anexo – Descrição dos Campos das Figuras	Nos campos de Rebate foi incluído o símbolo de percentual ex.: (%).
06/01/2014	23/01/2014	Inclusão de Nova Figura	Inclusão dos campos específicos à nova figura – COE001032 – Participation Forward Flex
06/01/2014	16/01/2014	Procedimento para criação de novas figuras	Inclusão de Orientação para acesso a esse documento.

Introdução ao COE

Conhecendo o Módulo

Este manual tem como objetivo oferecer as informações técnicas para realizar as emissões de COE e as demais operações do módulo de COE.

Observação: Para maiores informações sobre como acessar o módulo, consulte o Manual do NoMe.

Serviço de Atendimento ao Mercado

Embora já estejam disponíveis diversas figuras, funcionalidades e ativos subjacentes para registro de COEs, a B3 entende que o mercado é dinâmico e evolui com rapidez para aproveitar as oportunidades.

E para atender as instituições financeiras nesse ambiente competitivo, a B3 disponibiliza uma equipe especializada para o atendimento de novas demandas para o COE.

As solicitações podem ser das mais diversas, sendo as principais:

- Disponibilização de novos ativo-subjacentes
- Criação de novas figuras

Qualquer tipo de solicitação, crítica, dúvida e/ou sugestão podem ser tratadas nos seguintes canais:

Time Produtos – Derivativos e COE

Telefones: (11) 2565-5966/5956/5954/5950/6532

E-mail: derivativo@b3.com.br

Time Operações – Derivativos de Balcão

Telefone: (11) 2565-5044

E-mail: op.derivativosbalcao@b3.com.br

Ações dos botões das telas

Os botões das telas exibidos ao longo do manual estão relacionados às seguintes ações:

Botão	Ação
Enviar	Envia os dados informados para validação
Limpar campos	Limpa todos os campos selecionados e digitados
Voltar	Retorna à tela anterior, exibindo os filtros com os dados selecionados anteriormente.
Desistir	Sai da função, retornando à tela da área de serviços em branco.
Confirmar	Confirma os dados informados em tela
Corrigir	Retorna a tela anterior
Pesquisar	Submete os dados selecionados para pesquisa
Atualizar	Reexecuta a consulta a partir dos filtros selecionados na tela anterior, atualizando eventuais dados que tenham sido alterados entre a consulta e a nova atualização da Tela de Relação.
Sair	Sai da função, retornando à tela da área de serviços em branco.

Lançamentos

Registro/Emissão

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Registro/Emissão

Visão Geral

Essa função permite ao registrador efetuar o registro/alteração/exclusão do COE.

Resolução CVM 8

Caso o COE seja emitido sob esta resolução, essa informação deve ser declarada no momento do registro por meio do campo “Resolução CVM 8”.

Observações sobre a possibilidade de emissão de COE com Entrega Física:

1. O Emissor é responsável pela indicação da entrega física e, portanto, deverá se atentar aos corretos procedimentos operacionais necessários a entrega dos ativos relacionados a emissão do COE.
2. Se o ativo alvo de entrega física estiver registrado na B3, Balcão B3, o emissor ou intermediário responsável deverá entrar em contato com o atendimento operacional da B3 para envio de carta solicitando a transferência do instrumento financeiro, na data da ocorrência da entrega.
3. Caso o ativo alvo de entrega física for uma ação depositada na Central Depositária da B3 no Segmento BM&FBOVESPA, o Emissor deverá seguir os procedimentos por ela adotados.
4. A inconsistência das informações prestadas no registro ou da entrega física propriamente dita configura descumprimento de Regulamento da B3 e estará sujeito a sanções cabíveis previstas. O Participante deverá enviar Carta em caso de problemas relacionados à entrega física em até D+2 do vencimento do COE, contendo a justificativa a ser avaliada pela B3.
5. No Registro, Alteração e Aditamento, o campo “Entrega Física” está habilitado apenas para as classes **Ações e Títulos Privados**.

Tela filtro Registro/Emissão Certificado de Operações Estruturadas

Filtro Registro/Emissão Certificado de Operações Estruturadas		
Instrumento Financeiro		
Conta Emissora	10020	40 3
Código IF	<input type="text"/>	
Tipo de COE	COE001001 - Call	
Classe do Ativo Subjacente	CESTA	
Ação	INCLUIR	
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos campos da tela filtro Registro/Emissão Certificado de Operações Estruturadas

Campo	Descrição	Obrigatoriedade de Preenchimento
Conta Emissora	Conta tipo 40 (emissor).	Sim
Código IF	<p>Nos casos de registro de COE o campo “Código do IF” não deve ser preenchido. O sistema gera automaticamente o código seguindo as regras predefinidas descritas abaixo. Cada código deve seguir a estrutura: MMFFAAMSSSS</p> <p>Onde:</p> <p>MM – É o Mnemônico da Instituição Financeira responsável pela emissão do COE,</p> <p>FF – Refere-se a figura (ou payoff) de um determinado COE,</p> <p>AA – É referente ao ano de emissão deste COE,</p> <p>M – Refere-se ao Mês de emissão do COE,</p> <p>SSSS – É referente ao código sequencial de cada COE.</p> <p>Nos casos de alteração e exclusão o Código do IF é de preenchimento obrigatório.</p> <p>O código sequencial começa com 0000 e a partir deste é somado uma unidade a cada nova emissão. O código sequencial é alfa numérico, assim sendo, após a inclusão da emissão com 9999 o sistema iniciará uma nova sequência com A000 e assim sucessivamente até o limite de ZZZZ.</p>	Sim para Alteração e Exclusão

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Campo	Descrição	Obrigatoriedade de Preenchimento
Tipo do COE	Caixa de seleção com os tipos de COE já existentes.	Sim para Inclusão de COE
Classe do Ativo Subjacente	Campo onde é informada a classe do ativo subjacente a ser utilizado no COE. Caixa de seleção com as opções: Taxas de Câmbio, Commodities, Ações, Índices, Ações Internacionais e Índices Internacionais, Cesta.	Sim para Inclusão de COE
Ação	Campo com as opções: - Incluir (Registro do COE) - Alterar (Alteração/Aditamento) - Excluir (só é permitida a exclusão do COE, caso não tenha ocorrido a operação de depósito. A exclusão será comandada unilateralmente pelo Emissor.). - Reaproveitar (Para registrar um novo COE, reaproveitando as informações do instrumento financeiro já registrado cujo código deve ser informado no campo Código IF).	Sim

Ação Incluir

Após confirmar os dados, o sistema envia a tela abaixo. Na parte superior existem campos comuns a todos os COEs e na parte inferior existem campos específicos de cada figura (payoff) do COE.

Tela Registro/Emissão do Certificado de Operações Estruturadas

Cadastramento/Emissão Certificado de Operações Estruturadas		
Instrumento Financeiro		
Conta Emissora 05000.40-7	Tipo de COE COE001001 - Call	
Classe do Ativo Subjacente ACOES	Nome Fantasia <input type="text"/>	
Ativo Subjacente SELECIONE <input type="text"/>	Data de Emissão <input type="text"/>	
Data de Vencimento <input type="text"/>	Quantidade Emitida <input type="text"/>	
Valor Unitário de Emissão <input type="text"/>	Valor Financeiro de Emissão <input type="text"/>	
Capital Garantido (%) <input type="text"/>	Valor Inicial do Ativo Subjacente <input type="text"/>	
Data Emissão a termo <input type="text"/>	Código ISIN <input type="text"/>	
Modalidade <input type="text"/>	Base Aplicação (%) <input type="text"/>	
Resolução CVM 8 <input type="text"/>	Conta Escriturador <input type="text"/>	
Proteção contra proventos <input type="text"/>	Posição do emissor no derivativo <input type="text"/>	
Tipo de Regime <input type="text"/>	Remunerador no Vencimento <input type="text"/>	
Descrição remunerador <input type="text"/>	Remunerador Flutuante (%) <input type="text"/>	
Spread/Cupom (%) <input type="text"/>	Base <input type="text"/>	
Cotação Inicial Remunerador <input type="text"/>	Data Inicial Remunerador <input type="text"/>	
Data Final Remunerador <input type="text"/>	Resgate antecipado <input type="text"/>	
Condição Especifica de Resgate <input type="text"/>	Cláusula de Resgate pelo Emissor <input type="text"/>	
Código Identificador <input type="text"/>	Entrega Física <input type="text"/>	
Descrição Entrega Física <input type="text"/>	Pagamento Extraordinário <input type="text"/>	
Funcionalidade <input type="text"/>	Fluxo de Caixa Não <input type="text"/>	
Lookback <input type="text"/>	Critério de Lookback <input type="text"/>	
Data Inicial de Lookback <input type="text"/>	Data Final de Lookback <input type="text"/>	
Operação de Depósito		
Conta do Favorecido <input type="text"/>	CPF/CNPJ (Cliente) <input type="text"/>	Natureza (Cliente) <input type="text"/>
Meu número <input type="text"/>	P.U. <input type="text"/>	Modalidade <input type="text"/>
Liquidante <input type="text"/>		
Dados específicos		
Strike 1(%) <input type="text"/>	<input type="text"/>	
Quantidade 1 <input type="text"/>	<input type="text"/>	
Participação cenário de alta (%) <input type="text"/>	<input type="text"/>	
Período de captura do ativo subjacente para liquidação <input type="text"/>	SELECIONE <input type="text"/>	
Data inicial para fixing <input type="text"/>	<input type="text"/>	
Data final para fixing <input type="text"/>	<input type="text"/>	
Data para fixing <input type="text"/>	<input type="text"/>	
Tipo de Cotação para Liquidação <input type="text"/>	SELECIONE <input type="text"/>	
Tipo de Fixing para Vencimento <input type="text"/>	SELECIONE <input type="text"/>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos campos da tela Registro/Emissão do Certificado de Operações Estruturada

Campo	Descrição
Instrumento Financeiro	
Nome Fantasia	Campo de preenchimento obrigatório. Campo para que o participante titule o COE emitido. Formato: alfanumérico com 30 posições.
Ativo Subjacente	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Campo com as opções dos Ativos Subjacentes referentes a Classe do Ativo Subjacente selecionada anteriormente. O Ativo Subjacente é o Índice de Valorização do COE.
Data de Emissão	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: DD/MM/AAAA. Deve ser registrado em dia útil de acordo com o calendário nacional.
Data de Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: DD/MM/AAAA. Deve ser um dia útil de acordo com o calendário nacional.
Quantidade Emitida	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 12 posições. Quantidade emitida do COE. A Quantidade emitida deverá ser um número inteiro.
Valor Unitário de Emissão	Campo de preenchimento obrigatório. Preço unitário do COE. Formato: numérico com 12 inteiros e 8 decimais.
Valor Financeiro de Emissão	Campo de preenchimento obrigatório Formato: numérico com 16 inteiros e 2 decimais. Quantidade Emitida x Valor Unitário de Emissão.
Capital Garantido (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 3 inteiros e 4 decimais. Valor do percentual de capital garantido do COE. O Capital Garantido está atrelado a Modalidade selecionada para o COE.

Campo	Descrição
Valor Inicial do Ativo Subjacente	<p>Para os ativos subjacentes não calculados, é obrigatório o preenchimento.</p> <p>Para os ativos subjacentes calculados, o preenchimento é opcional. Ao preencher o valor inicial do Ativo Subjacente o sistema acatará o valor informado. Caso não seja preenchido, o sistema utilizará a cotação do dia útil anterior ao início do COE como valor inicial.</p> <p>O valor inicial é utilizado para o cálculo (os percentuais indicados nos campos incidirão sobre este campo) de barreiras, strikes e outros valores da operação.</p> <p>Caso a classe do ativo subjacente selecionada for CESTA, este campo não deverá ser preenchido. O sistema adotará 10.000 como valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Caso o COE seja emitido a termo, este campo poderá ser preenchido de 2 maneiras:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Se o ativo subjacente não for calculado o preenchimento é obrigatório e o emissor ajusta este valor inicial até o início da operação, inclusive. • Se o ativo subjacente for calculado o preenchimento não é obrigatório. <p>Formato: numérico com 12 inteiros e 8 decimais.</p>
Data Emissão a Termo	<p>Campo referente a data de início de um COE a termo.</p> <p>Campo opcional, só devendo ser preenchido nos casos de COE a Termo.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Código ISIN	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Formato: alfanumérico com 12 posições.</p>
Modalidade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Capital Investido Garantido e Perda Limitada ao Capital Investido.</p> <p>Quando “Capital Investido Garantido”: Capital Garantido deverá ser maior ou igual à 100%</p> <p>Quando “Perda Limitado ao Capital Investido”: Capital Garantido deverá ser maior ou igual a 0 e menor que 100%.</p>
Base Aplicação (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor do percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão. Este valor se refere à aplicação que protegerá o capital investido, de acordo com o percentual estipulado no campo “Capital Garantido”, ou seja, passa a ser patamar da operação, caso não haja o exercício do Derivativo associado.</p>

Campo	Descrição
Resolução CVM 8	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>O campo deve ser preenchido com SIM apenas para quando o COE que forem objeto de oferta pública de distribuição.</p>
Conta Escriturador	Campo deverá ser mantido vazio/em branco.
Proteção contra Proventos	<p>Campo disponível para Ações Nacionais e Internacionais.</p> <p>Se a classe do Ativo Subjacente for Ações Nacionais, o campo vem com as opções “Sim – Ajustado pelo Emissor”, “Sim – Cetip” e “Não”.</p> <p>Para os eventos de proventos em quantidade das Ações Nacionais (Inplit/Split/Bonificação) o sistema irá ajustar automaticamente o Valor Inicial do Ativo Subjacente caso sejam selecionadas as opções: “Sim – Cetip” ou “Não”.</p> <p>Se a classe do Ativo Subjacente for Ações Internacionais, o campo vem com as opções “Sim – Ajustado pelo Emissor” e “Não”.</p> <p>Para qualquer tipo de evento das Ações Internacionais o sistema não irá ajustar o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Quando selecionada a opção “Sim – Ajustado pelo Emissor”, o emissor deverá utilizar a função de <u>Atualização de PU > Valor Inicial do Ativo Subjacente</u> para refletir eventuais proventos em quantidade (e/ou em dinheiro). A utilização da função <u>Atualização de PU > Valor Inicial do Ativo Subjacente</u> pode ser feita até D-1 da data de vencimento do COE.</p> <p>Quando selecionada a opção “Sim – Ajustado pelo Emissor”, a captura automática da cotação do ativo subjacente é desligada, de forma que será necessário para o emissor realizar a atualização de PU no item “Cotação para Fixing” no vencimento do COE.</p> <p>A opção “Sim – Cetip” não pode ser escolhida no caso de Lookback.</p>
Posição do emissor no derivativo	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Comprado e Vendido.</p> <p>Indica se o emissor está comprado (ativo) ou vendido (passivo) no derivativo.</p>
Tipo de Regime	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: DEPOSITADO e REGISTRADO.</p>

Campo	Descrição
Remunerador no Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Representa, quando houver, o indexador indicado para remunerar o Valor Unitário de Emissão exclusivamente no vencimento.</p> <p>Campo com as opções: Sem remuneração, Pré, DI, IPCA VCP, IBOVESPA VCP, IBOVESPA, USD VCP, USD, No período e PRÉ LIN/360 + VC USD.</p> <p>Importante: O remunerador indicado nesse campo não será aplicado para a remuneração do fluxo de caixa, apenas para o vencimento. Para indicar a remuneração do fluxo de caixa, se houver, o indexador deverá ser indicado no campo “Remunerador no Fluxo” na seção de fluxo de caixa.</p>
Descrição Remunerador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se o “Remunerador no vencimento” indicado for IPCA VCP ou IBOVESPA VCP ou USD VCP.</p> <p>Formato: texto com 300 posições.</p>
Remunerador Flutuante (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se o “Remunerador no vencimento” for DI, USD e IBOVESPA.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Spread/Cupom (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se o “Remunerador no vencimento” indicado for Pré ou No Período.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais.</p>
Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando informado o campo Spread/Cupom (%).</p> <p>Campo com as opções: 252 exp, 360 exp e 360 lin.</p> <p>Não preencher se “Remunerador no vencimento” indicado for “No Período”.</p> <p>Campo indicador para informar a base do Remunerador no vencimento.</p>
Cotação Inicial Remunerador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Só pode ser preenchido quando o “Remunerador no vencimento” for “IBOVESPA” ou “DOLAR” e o campo “DATA INICIAL REMUNERADOR” estiver vazio.</p> <p>Indica a cotação inicial a ser utilizada para valorização do Remunerador no vencimento.</p> <p>IPCA VCP, IBOVESPA VCP E USD VCP os campos são opcionais (apenas informativos).</p> <p>Não pode ser preenchido se “Remunerador no vencimento” igual a SEM REMUNERACAO, DI e PRE.</p>

Campo	Descrição						
Data Inicial Remunerador	Não pode ser menor do que a data de emissão do COE ou a data de emissão a termo, caso preenchida. Deve ser dias úteis do calendário nacional. Campo no formato DD/MM/AAAA e não obrigatório.						
Data Final Remunerador	Deve ser dias úteis do calendário nacional. Campo no formato DD/MM/AAAA e não obrigatório.						
Resgate Antecipado	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se pode existir a condição de resgate antecipado. <u>Não tem condição:</u> sem condição para antecipação de resgate. <u>Tem condição a mercado:</u> Resgate antecipado está sujeita exclusivamente às condições de mercado apuradas na data de antecipação do resgate. <u>Condição específica:</u> Condição pré-definida pelo emissor do COE, que permite o resgate antecipado do IF caso a condição seja atingida.						
Condição Específica de Resgate	Campo de preenchimento obrigatório se for selecionado “Condição Específica” no campo “Resgate Antecipado” Indica a condição específica de resgate da emissão. Combo com domínios disponíveis conforme abaixo:						
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Domínios*</th> <th>Descrição</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Detalhadas nas documentações de emissão</td> <td>Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.</td> </tr> <tr> <td>Verificação de níveis de preço</td> <td>Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.</td> </tr> </tbody> </table>	Domínios*	Descrição	Detalhadas nas documentações de emissão	Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.	Verificação de níveis de preço	Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.
Domínios*	Descrição						
Detalhadas nas documentações de emissão	Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.						
Verificação de níveis de preço	Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.						

*: Os domínios são criados sob demanda do Emissor

Campo	Descrição
Cláusula de Resgate pelo Emissor	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Caixa com as opções: Sim e Vazio.</p> <p>Quando selecionado “Sim” indica que o Emissor poderá realizar o resgate total do COE unilateralmente, , ou seja, sem duplo comando da contraparte. O resgate é feito por meio da função “Regate Antecipado”</p>
Código Identificador	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Formato: texto com 20 posições</p>
Variação Quanto	<p>Campo de preenchimento obrigatório se a Classe do Ativo Subjacente for Taxas de Câmbio, Ações Internacionais, Índices Internacionais, Cesta e Títulos Públicos e Privados. Para Commodities, o campo é obrigatório se a moeda em que a mercadoria é cotada não for o real.</p> <p>Campo para informar se a valorização do ativo subjacente será em real ou na moeda do ativo.</p> <p><u>Se a opção selecionada for Sim:</u> Não será contabilizada a variação da moeda do ativo.</p> <p><u>Se a opção selecionada for Não:</u> Será contabilizada a variação da moeda do ativo.</p>
Data Inicial Paridade Não Quanto	<p>Não preencher se o campo “Valor Inicial Paridade” estiver preenchido.</p> <p>Pode ser até D-5 da Data de Emissão ou da Data de Emissão a Termo, se preenchido e deverá ser menor do que a “Data Fixing Paridade Não Quanto”.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA. A data indicada deve ser dia útil do calendário nacional.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data Fixing Paridade Não Quanto	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando a moeda for diferente de BRL. Se moeda igual a BRL, o campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA. A data indicada deve ser dia útil do calendário nacional.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Valor Inicial da Paridade	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Variação Quanto” for preenchido com a opção “Não”.</p> <p>Não preencher se o campo “Data Inicial Paridade Não Quanto” estiver preenchido.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Valor inicial de conversão cambial para o ativo internacional.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 8 decimais.</p>

Campo	Descrição
Entrega Física	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando a classe do ativo subjacente for Ações ou Títulos Privados. Quando a classe for outra, o campo não será habilitado.</p> <p>Exclusivo para COE alienado pelo Emissor, para seu Cliente (1 ou 2).</p> <p>Caixa com as opções: vazio e Sim.</p>
Descrição Entrega Física	<p>Campo de preenchimento opcional, quando a classe do ativo subjacente for Ações ou Títulos Privados. Quando a classe for outra, o campo não será habilitado.</p>
Pagamento Extraordinário	<p>Campo disponível para as seguintes classes de Ativos Subjacentes: Ações Nacionais; Ações Internacionais; Índices, Índices Internacionais; Taxas de Cambio; Títulos Privados Nacionais; Títulos Privados Internacionais; Títulos Públicos Nacionais; Títulos Públicos Internacionais; e Cesta.</p> <p>Atenção: Observar as condições permitidas para uso na função “Indicação de Pagamento Extraordinário”.</p> <p>Com os domínios: Branco, Sim – Final e Sim – Fluxo.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Branco: sistema não gera operação. • Sim – Final: sistema gera a operação de pagamento extraordinário no vencimento • Sim – Fluxo: sistema gera a operação de pagamento extraordinário nas datas de fluxo (indicadas no momento do registro). <p>A opção Sim - Fluxo, não pode ser utilizado para COE que não tenha Fluxo de Caixa.</p>
Funcionalidade	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Com os domínios: Watermark Performance, Performance Acumulada</p> <p>Campo que indica as funcionalidades que podem ser adicionadas ao COE</p> <p>Para mais informações sobre as funcionalidades disponíveis, consultar a seção Funcionalidade.</p>
Fluxo de Caixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Com os domínios: “Sim” e “Não”.</p> <p>Indica se o COE terá eventos intermediários.</p> <p>Quando indicado SIM, os dados específicos do fluxo serão informados na seção de Fluxo de Caixa.</p>
Lookback	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Caixa com as opções: “Sim” e “Não”.</p>

Campo	Descrição
Critério de Lookback	<p>Campo de preenchimento obrigatório se Lookback igual a "SIM" e não deve ser preenchido se Lookback igual a "Não".</p> <p>Caixa com as opções: Máximo, Mínimo e VAZIO.</p>
Data Inicial de Lookback	<p>Campo de preenchimento obrigatório se Lookback igual a "SIM" e não deve ser preenchido se Lookback igual a "Não".</p> <p>O campo deve ser igual ou maior do que a data de Emissão do COE.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA.</p>
Data Final de Lookback	<p>Campo de preenchimento obrigatório se Lookback igual a "SIM".</p> <p>O campo deve ser igual ou menor do que D-1 da data de vencimento e maior ou igual a Data Inicial de Lookback.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA.</p> <p>Nesta data, o sistema criará a pendência "Valores Lookback", de forma que o emissor terá a opção de atualizar o valor inicial do ativo subjacente conforme critério adotado.</p> <p>O lançamento deverá ser feito via atualização de PU (atualização valores lookback).</p>
Dados Específicos – COE001007 - Straddle (utilizado como exemplo da tela)	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Numero indicando a quantidade de opções que devem ser utilizadas no Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para o Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>Máximo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Mínimo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Média no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p>

Após clicar no botão **Enviar**, aparecerá a tela para confirmação dos dados. E se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “Cesta” o sistema apresentará a tela abaixo:

Após clicar no botão **Prosseguir**, o sistema apresentará a tela abaixo:

Tela Parametrização de Cesta

Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema apresentará a tela abaixo:

Parametrização de Cesta				
Ação ALTERAÇÃO				
Tipo de Cesta STANDARD				
Moeda paridade	Valor inicial paridade	Data Fixing Paridade		
DOLAR DOS EUA	3,07	25	06	2015
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
COBRE	FECHAMENTO	13	25/06/2015	50
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
CHUMBO	FECHAMENTO	12	25/06/2015	50
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Obs: As descrições dos campos estão na função **Parametrização de Cesta**.

Após informar os dados necessários e clicar no botão **Enviar** é apresentada tela de confirmação dos dados. Após confirmação, se o campo “Fluxo de Caixa” for igual a SIM o sistema apresenta a tela abaixo:

Parametrização de Cesta	
Certificado de Operações Estruturadas 'LE0115F74VT' incluído com sucesso	
<input type="button" value="Prosseguir"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Após clicar no botão **Prosseguir**, o sistema apresenta a tela abaixo:

Filtro de Fluxo de Caixa COE	
Código IF LE0115F74VT	
Número de Datas de Eventos	1
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Obs: É permitido a indicação de até 999 datas de evento

Essa função permite indicar a inclusão de uma agenda de datas para:

- Pagamento remunerador do fluxo caso seja atingida a barreira do cupom,
- Pagamento do remunerador do fluxo sem indicação de barreira e;
- Verificação de disparo de barreira de chamada (Autocall)

Após preenchimento do campo “Número de Datas de Eventos” e confirmar o sistema apresenta a tela abaixo:

> Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Cadastramento/Emissão HOMOLOGAÇÃO

Registro Fluxo de Caixa - COE

Condicionante de Barreira Cupom (%) Remunerador no Fluxo Base Condicionante de Barreira Chamada (%)

Memória de Cupom

Data	Remunerador (%)	Spread/Cupom (%)	Barreira Cupom (%)	Barreira Cupom 2 (%)	Barreira Chamada (%)	Barreira Chamada 2 (%)	Data Fixing	Data Fixing 2	Tipo de Fixing
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
20/8/2021	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>

Obs: As descrições dos campos estão na função Fluxo de Caixa.

Após informar os dados necessários e clicar no botão **Enviar** é apresentada tela de confirmação dos dados. Após confirmação o sistema a mensagem abaixo:

Certificado de Operações Estruturadas 'LE0115F74VT' incluído com sucesso

Ação Alterar

Na Alteração de um COE deve ser preenchido o Código do IF e selecionar no campo “Ação” a opção “ALTERAR”,

A “ALTERAÇÃO” pode ser efetuada pelo emissor/registrador. Somente poderão ser objetos de alteração os instrumentos financeiros que foram emitidos e que ainda não tenha sido efetuada a operação de depósito.

Campos que podem ser alterados pelo participante:

- Data de Vencimento
- Prazo de Emissão
- Quantidade
- Valor Unitário de Emissão
- Valor Financeiro de Emissão
- Código ISIN
- Nome Fantasia
- Modalidade
- % do Capital Garantido
- Ativo Subjacente
- Valor Inicial do Ativo Subjacente
- Resolução CVM 8
- Proteção contra Proventos?
- Posição no Derivativo do Emissor
- Cálculo do COE
- Remunerador no vencimento
- Funcionalidade
- % de Remunerador Flutuante
- Spread/Cupom
- Base
- Resgate Antecipado

Além dos campos acima, todos os campos complementares ao registro do Instrumento Financeiro (específico a cada figura) poderão ser alterados.

Fluxo de Caixa

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Fluxo de Caixa

Visão Geral

Essa função permite ao emissor completar o preenchimento do fluxo, que ficou com o status **PENDENTE FLUXO DE CAIXA** na função de Registro/Emissão.

Tela Filtro de Fluxo de Caixa COE

Descrição dos campos da tela Filtro de Fluxo de Caixa COE

Campo	Descrição
Campos de preenchimento obrigatório	
Conta Emissora	Conta tipo 40 (emissor).
Código IF	Código do COE.
Ação	Caixa com as opções: ALTERAR e INCLUIR.
Manter Fluxo Atual?	Caixa com as opções: "SIM" e "NÃO".
Número de Datas de Eventos	Não preencher se "Manter Fluxo Atual?" for igual a "SIM". Permitido indicar até 999 datas de evento.

Tela Registro Fluxo de Caixa - COE

Registro Fluxo de Caixa - COE										
Condicionante de Barreira Cupom (%)	Remunerador no Fluxo		Base		Condicionante de Barreira Chamada (%)					
Memória de Cupom										
Data	Remunerador (%)	Spread/Cupom (%)	Barreira Cupom (%)	Barreira Cupom 2 (%)	Barreira Chamada (%)	Barreira Chamada 2 (%)	Data Fixing	Data Fixing 2	Tipo de Fixing	
20/08/2021										
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>										

Descrição dos campos da tela Registro de Fluxo de Caixa COE

Campo	Descrição
Condicionante de Barreira Cupom (%)	<p>Preenchimento obrigatório se algum dos campos Barreira Cupom (%) do fluxo estiver preenchido.</p> <p>Caixa com as opções: Vazio, Acima, Abaixo e Entre.</p> <ul style="list-style-type: none"> Se “ACIMA”: a barreira é atingida caso a cotação para fixing seja maior ou igual à “Barreira Cupom (%)”. Se “ABAIXO”: a barreira é atingida caso a cotação para fixing seja menor ou igual à “Barreira Cupom (%)” Se “ENTRE”, a barreira é atingida caso a cotação para fixing fique entre a “Barreira Cupom (%)” e a “Barreira Cupom 2 (%)”, ou seja, maior ou igual a “Barreira Cupom (%)” e menor ou igual a “Barreira Cupom 2 (%)”
Remunerador no Fluxo	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Com os domínios: SEM REMUNERAÇÃO, PRE, DI, IPCA VCP, USD VCP, NO PERÍODO</p> <p>Indica o indexador para pagamento de juros exclusivamente nas datas de evento informadas.</p> <p>Importante: O remunerador indicado nesse campo não será aplicado para a Remuneração no vencimento, somente para as datas de evento do fluxo de caixa. Para indicar a remuneração do vencimento, se houver, o indexador deverá ser indicado no campo “Remunerador no vencimento” na seção de campos fixos do COE (Registro/Emissão).</p>
Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando informado o campo Spread/Cupom (%).</p> <p>Com os domínios: 252 exp, 360 exp, 360 lin</p> <p>Indica a base de cálculo do cupom de juros do fluxo de caixa.</p>

Campo	Descrição
Condicionante de Barreira Chamada (%)	<p>Preenchimento obrigatório se algum dos campos Barreira Chamada (%) do fluxo estiver preenchido.</p> <p>Caixa com as opções: Vazio, Acima, Abaixo e Entre.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Se “ACIMA”: a barreira é atingida caso a cotação para fixing seja maior ou igual à “Barreira Chamada (%)”. • Se “ABAIXO”: a barreira é atingida caso a cotação para fixing seja menor ou igual à “Barreira Chamada (%)” <p>Se “ENTRE”, a barreira é atingida caso a cotação para fixing fique entre a “Barreira Cupom (%)” e a “Barreira Cupom 2 (%)”, ou seja, maior ou igual a “Barreira Cupom (%)” e menor ou igual a “Barreira Cupom 2 (%)”</p>
Memória de Cupom	<p>Caixa com as opções: SIM, NÃO</p> <p>Preenchido caso o COE tenha Memória de juros. Neste caso, o cupom do fluxo será pago quando a condição para pagamento seja atingida na data de verificação. Caso contrário será memorizado para pagamento na verificação subsequente todos os cupons não pagos desde o último pagamento.</p>
Data	<p>Campo de preenchimento obrigatório para todos os fluxos.</p> <p>A data de cada sequência deve ser maior que a data de início do COE, maior que a data anterior da sequência, menor que a data posterior e menor ou igual ao o vencimento.</p> <p>A última data do fluxo deve vir preenchida com a data de vencimento mas será passível de alteração.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA.</p>
Remunerador (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se “Remunerador no fluxo” for igual a “DI” e opcional se igual a “IPCA VCP”.</p> <p>Não deve ser preenchido se “Remunerador no fluxo” for igual a “PRE” ou “NO PERIODO”.</p> <p>Campo no formato numérico, (%) percentual de 4 inteiros e 4 decimais. Aceita valores positivos e superiores a zero.</p>
Spread/Cupom (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se “Remunerador no fluxo” for igual a “PRE” ou “NO PERIODO” e opcional se igual a “DI”, “IPCA VCP” ou “USD VCP”.</p> <p>Campo no formato numérico, (%) percentual de 5 inteiros e 4 decimais. Aceita valores positivos e zero.</p>

Campo	Descrição
Barreira Cupom (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório para pelo menos uma data do fluxo se o campo Condicionante de Barreira Cupom (%) estiver preenchido.</p> <p>Campo no formato numérico de 4 inteiros e 8 decimais, representando um percentual do Valor Inicial do Ativo Subjacente. O campo aceita valores positivos, negativos e zero.</p>
Barreira Cupom 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando campo “Condicionante de Barreira de Cupom (%)” é igual a “ENTRE”.</p> <p>Campo no formato numérico de 4 inteiros e 8 decimais, representando um percentual do Valor Inicial do Ativo Subjacente. O campo aceita valores positivos, negativos e zero.</p>
Barreira Chamada (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório para pelo menos uma data do fluxo se o campo Condicionante de Barreira Chamada (%) estiver preenchido.</p> <p>Campo no formato numérico de 4 inteiros e 8 decimais, representando um percentual do Valor Inicial do Ativo Subjacente. O campo aceita valores positivos, negativos e zero.</p>
Barreira Chamada 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando campo “Condicionante de Barreira de Chamada (%)” é igual a “ENTRE”</p> <p>Campo no formato numérico de 4 inteiros e 8 decimais, representando um percentual do Valor Inicial do Ativo Subjacente. O campo aceita valores positivos, negativos e zero.</p>
Data Fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a data de <i>fixing</i> do evento ou, se preenchido o campo “Data fixing 2”, indica a data inicial para formação do <i>fixing</i>.</p> <p>Não pode ser superior à data do evento, menor do que a data de emissão ou de início do COE ou final de semana.</p>
Data Fixing 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Se indicado, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing”</p> <p>Indica a data final para formação do <i>fixing</i> do evento</p> <p>Não pode ser superior à data do evento, menor do que a “Data fixing”, a data de emissão ou de início do COE ou final de semana.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing	<p data-bbox="540 275 1365 338">Campo de preenchimento obrigatório quando o campo “Data Fixing 2” estiver preenchido.</p> <p data-bbox="540 359 1304 422">Campo com os domínios: Máximo no período, Média no período, Mínimo no período, Verificação data a data</p> <ul data-bbox="586 443 1386 1201" style="list-style-type: none"><li data-bbox="586 443 1386 590">Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.<li data-bbox="586 611 1386 758">Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.<li data-bbox="586 779 1386 968">Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.<li data-bbox="586 989 1386 1201">Verificação data a data: O sistema irá utilizar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) para verificar o atingimento das barreiras do evento. A primeira cotação que atingir as condicionantes será utilizada como <i>fixing</i> do evento.

Marcação à Mercado

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Marcação a Mercado

Visão Geral

A Marcação à Mercado deve ser realizada mensalmente.

A informação de atualização do MtM dos COEs deve ser baseada na Quantidade em Estoque.

Tela Inclusão Marcação à Mercado COE

Inclusão Marcação A Mercado COE	
Código do COE	TH0713J040U
Conta Emissor	05000 . 40 - 7
Nome simplificado Emissor	RIOBM
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da tela Inclusão Marcação A Mercado COE

Campo	Descrição
Código do COE	Campo de preenchimento obrigatório.
Conta Emissor	Campo de preenchimento obrigatório. Conta do tipo 40.
Nome simplificado Emissor	Campo de preenchimento obrigatório.

Após a confirmação, o sistema apresenta a tela para preenchimento do valor e da data de referência.

Manutenção Marcação A Mercado COE	
Código do COE	TH0713J040U
Nome Fantasia	Straddle_20131022_Cen1
Conta Emissor	05000.40-7
Nome simplificado Emissor	RIOBM
Valor Atual de MtM	
Data de Atualização do MTM	22/10/2013 00:00:00
Atualizado por	
Sinal	CREDITO
Valor de MtM	2 ,
Data de Referência	23 / 10 / 2013
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da tela Inclusão Marcação a Mercado COE

Campo	Descrição
Sinal	Campo de preenchimento obrigatório. O emissor deve sempre informar a opção Débito.
Valor de MtM	Campo de preenchimento obrigatório Valor de mercado do COE na data informada no campo “Data de Referência”.
Data de Referência	Campo de preenchimento obrigatório. Data de Referência da Marcação à Mercado.

Após enviar os dados, aparece a tela para confirmação.

Manutenção Marcação A Mercado COE

Código do COE TH0713J04OU
Nome Fantasia Straddle_20131022_Cen1
Conta Emissor 05000.40-7
Nome simplificado Emissor RIOBM
Valor Atual de MtM
Data de Atualização do MTM 22/10/2013 00:00:00
Atualizado por
Sinal CREDITO
Valor de MtM 2,00000000
Data de Referência 23/10/2013

Após a confirmação, o sistema envia a mensagem abaixo.

Marcação a Mercado 'TH0713J04OU' Incluído com sucesso.

Operação de Depósito

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Depósito

Visão Geral

Essa função permite ao Emissor realizar a operação de depósito do COE.

IMPORTANTE

A operação de depósito do COE é apenas uma etapa de registro das informações no sistema. Esta etapa não se refere ao tipo de regime da emissão (Esta informação é inserida no campo “TIPO DE REGIME” da tela de registro).

A operação de COE pode ser efetuada:

1. sem financeiro:

- 1.1. entre emissor e Cliente (1 ou 2).
- 1.2. para o depósito de COE proveniente de outra infraestrutura, emitido em data anterior a da operação de depósito; e.

2. com financeiro, para o depósito de COE que seja alienado pelo Emissor para outro Participante ou para Cliente (1 ou 2) de outro Participante.

Os procedimentos aplicáveis ao registro da operação de depósito sem financeiro, nas duas formas referidas acima, bem como a operação de depósito com financeiro estão descritos a seguir.

O registro de depósito é permitido quando o instrumento financeiro estiver com situação **Confirmada**.

Observação: Caso a operação de depósito não seja feita no prazo de cinco dias, as características serão excluídas.

Tela Depósito de Instrumento Financeiro

Depósito de Instrumento Financeiro

Tipo do Instrumento Financeiro COE

Código do Instrumento Financeiro TH0713J04T4

Tipo de Depósito DEPOSITO SEM FINANCEIRO

Confirmar Limpar Campos Desistir

Descrição dos campos da Tela filtro Depósito de Instrumento Financeiro

Campo	Descrição
Código do Instrumento Financeiro	Campo de preenchimento obrigatório. Código Cetip do Instrumento Financeiro
Tipo de Depósito	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Depósito sem Financeiro e Depósito com Financeiro

Opção I – Operação de Depósito sem financeiro**Opção I. 1: Operação de Depósito sem financeiro de COE que seja alienado pelo Emissor para seu Cliente (1 ou 2)**

Depósito de Instrumento Financeiro

Tipo do Instrumento Financeiro COE
Código do Instrumento Financeiro TH0115C6YGB

Papel

Parte ..

Meu Número

Contraparte ..

Quantidade

Depósito em posição de Bloqueio Judicial

Número do Processo

Vara

Dados Complementares

CPF/CNPJ (Cliente) Natureza (Cliente)

Descrição dos campos da Tela da Operação de Depósito sem financeiro

Campo	Descrição
Depósito do Instrumento Financeiro – Campos de preenchimento obrigatório.	
Papel	Indica o participante que está efetuando o lançamento. Caixa de seleção com as opções: Detentor e Emissor.
Parte	Código Cetip do participante lançador da operação. Se Parte for Detentor, tipo de conta deve ser 00 ou 10 ou 20 ou de 70 a 89 ou 96.
Meu Número	Número do lançamento. Não é obrigatório que Parte e Contraparte informem o mesmo número.
Contraparte	Código Cetip da contraparte da operação. Tipo de conta deve ser 00 ou 10 ou 20 ou 69 ou de 70 a 89 ou 96, se Papel Parte for igual Emissor/Registrador.
Quantidade	Quantidade do ativo a ser depositado. O valor financeiro desta operação é obtido com multiplicação da Quantidade pelo PU.

Campo	Descrição
Depósito em Posição de Bloqueio Judicial	Campo de preenchimento opcional. Permite que o depósito ocorra em posição de Bloqueio Judicial.
Número do Processo	Campo de preenchimento opcional. Habilitado quando “Depósito em posição de Bloqueio Judicial” for igual “Sim”. Informa o número do processo judicial.
Vara	Campo de preenchimento opcional. Habilitado quando “Depósito em posição de Bloqueio Judicial” for igual “Sim”. Informa a Vara do processo judicial.
Dados Complementares – Campos de preenchimento obrigatório somente se a conta detentora for uma conta cliente. Se a operação for entre mercado e o detentor for conta cliente, a indicação dos dados complementares deverá ser feito apenas pelo detentor.	
CPF/CNPJ (Cliente)	Preencher se Parte ou Contraparte Cliente1 ou Cliente2. O CPF ou CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Caso não esteja cadastrado no SIC, a operação ficará com status Pendente de Especificação.
Natureza (Cliente)	Caixa de seleção com as opções: PJ e PF Deve ser indicado se o campo CPF/CNPJ (Cliente) for preenchido.

Permite ao participante Emissor/Detentor efetuar lançamento de uma operação de Depósito sem financeiro, não sendo permitida a informação de PU.

Para o registro de operação de depósito sem financeiro, cursará a grade **Sem Modalidade**.

Após informar os dados necessários e clicar no botão **Confirmar** é apresentada tela de confirmação dos dados.

O sistema permite que a operação de depósito sem financeiro seja cancelada mesmo após ter sido confirmada, desde que no próprio dia do registro da operação original.

Opção I. 2: Operação de Depósito sem financeiro de COE proveniente de outra infraestrutura, emitido em data anterior a do depósito.

A operação de depósito sem financeiro de COE proveniente de outra infraestrutura deve ser solicitado:

1. Quando favorecido for Participante ou Cliente distinto do Emissor, será solicitada pelo Participante titular, mediante entrega de correspondência à B3 assinada pelo Participante e pelo Emissor.
2. caso o titular do COE seja Cliente (1 ou 2) do Emissor do COE, mediante entrega de correspondência à B3 assinada por esse Emissor.

Opção II: Depósito com financeiro

Depósito de Instrumento Financeiro com Financeiro			
Dados da Operação			
Tipo IF COE		Código IF TH0713J04T4	
Parte			Contraparte
Papel Parte <input type="text"/>	Código Parte <input type="text"/>	Meu Número <input type="text"/>	Código Contraparte <input type="text"/>
Número da Associação <input type="text"/>			
Liquidação Financeira			Dados da Operação
Liquidante <input type="text"/>	Modalidade Bruta		Quantidade <input type="text"/>
			P.U. <input type="text"/>
Dados Complementares			
CPF/CNPJ (Cliente) <input type="text"/>		Natureza (Cliente) <input type="text"/>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Permite ao participante Emissor/Detentor efetuar lançamento de uma operação de depósito com financeiro, sendo exigida a informação de PU. Para o registro de operação de depósito com financeiro deverão ser obedecidas as regras em relação à modalidade de liquidação permitida e aos horários definidos.

A operação de depósito com financeiro pode ser cancelada se ainda não tiver sido liquidado financeiramente.

Descrição dos campos da Tela de Operação de Depósito com financeiro

Campo	Descrição
Parte e Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório.	
Papel Parte	Indica o participante que está efetuando o lançamento. Caixa de seleção com as opções: Detentor e Emissor/Registrador
Código Parte	Código Cetip do participante lançador da operação. Se Parte for Detentor, tipo de conta deve ser 00 ou 10 ou 20 ou 69 ou de 70 a 89 ou 96.
Meu Número	Número do lançamento. Não é obrigatório que Parte e Contraparte informem o mesmo número.
Número da Associação	Deve ser preenchido quando Parte for tipo de conta 69-Intermediação. Número que permite associar operações que deverão ser avaliadas em conjunto.

Campo	Descrição
Código	Código Cetip da contraparte da operação.
Contraparte	Tipo de conta deve ser 00 ou 10 ou 20 ou 69 ou de 70 a 89 ou 96, se Papel Parte for igual Emissor/Registrador.
Liquidação Financeira – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Liquidante	Código Cetip do Banco Liquidante da operação.
Modalidade	Modalidade de liquidação da operação. Caixa de seleção com as opções: Bruta e Bilateral
Dados da Operação – Campos de preenchimento obrigatório.	
Quantidade	Quantidade do ativo a ser depositado. O valor financeiro desta operação é obtido com multiplicação da Quantidade pelo PU.
PU	Preço unitário do ativo. Formato: Numérico com 9 inteiros e 8 decimais.
Dados Complementares – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
CPF/CNPJ (Cliente)	Preencher se Parte ou Contraparte Cliente1 ou Cliente 2. O CPF ou CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Caso não esteja cadastrado no SIC, a operação ficará com status Pendente de Especificação.
Natureza (Cliente)	Caixa de seleção com as opções: PJ e PF Deve ser indicado se o campo CPF/CNPJ (Cliente) for preenchido.

Após informar os dados necessários e clicar no botão **Enviar** é apresentada tela de confirmação dos dados. Após confirmação, é efetuado a operação de depósito na conta do Participante Detentor da quantidade informada e o sistema envia com o número do lançamento efetuado.

Resgate Antecipado

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Resgate Antecipado

Visão Geral

Esta função permite ao Registrador/Emissor resgatar antecipadamente a quantidade total ou parcial do ativo em custódia do participante. A situação do Instrumento Financeiro deve estar como **Confirmada**.

O valor financeiro da operação, exibido na tela de confirmação, é calculado pelo sistema com a multiplicação da Quantidade a ser antecipada pelo Preço Unitário informado no item de tela **Dados da Operação** desta função.

Tela Resgate Antecipado

Resgate Antecipado	
Tipo do IF	COE
Código IF	<input type="text"/>
Motivo	<input type="text"/>
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

*O campo “Motivo” é de preenchimento opcional e apresenta a opção Ordem Judicial. Esta opção habilita campos específicos para realização da Operação de Resgate Antecipado por Ordem Judicial.

Tela Resgate Antecipado

Resgate Antecipado			
Instrumento Financeiro			
Tipo	Código IF	Data operação	
COE	TL0151G665Z	17/09/2020	
Parte			Contraparte
Papel	Código	Meu Número	Código
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Liquidação Financeira		Dados da Operação	
Liquidante	Modalidade	Quantidade	Preço Unitário
<input type="text"/>	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Dados Complementares			
Reserva Técnica	Data op. Original	Número Oper. CETIP	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	
CPF/CNPJ (Cliente)	Natureza (Cliente)	Motivo	
<input type="text"/>	<input type="text"/>	ORDEM JUDICIAL	
Posição Origem - Bloqueio Judicial	Num. Cetip Op. Original - Bloqueio Judicial		
<input type="text"/>	<input type="text"/>		
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação da operação. Se o registro for confirmado, é apresentada mensagem informando o lançamento de operação.

A operação que permanecer até o final da grade de liquidação com a situação **Pendente** será **Estornada**.

Assim que finalizada a operação, o detentor também deverá realizar o lançamento de forma a consolidar o duplo comando, sendo que depois de confirmado, o detentor necessitará realizar a identificação de comitentes no SIC O duplo comando **não será necessário** caso o Resgate seja total e estiver indicado no registro o campo “Cláusula de Resgate pelo Emissor” = “Sim”.

Descrição dos campos da Tela de Resgate Antecipado

Campo	Descrição
-------	-----------

Parte e Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório.

Papel	Caixa de seleção com as opções: Emissor e Detentor.
Código	Código Cetip do Participante que está efetuando o lançamento (Emissor ou Detentor). Tipos de conta do detentor: 00 ou 10 (emissor ou terceiros) ou 20 ou de 70 a 89 ou 96.
Meu Número	Número da operação de resgate.
Código	Código Cetip da Contraparte na operação (Emissor ou Detentor). Tipos de conta do detentor: 00 ou 10 (emissor ou terceiros) ou 20 ou de 70 a 89 ou 96.

Liquidação Financeira – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.

Liquidante	Deve ser preenchido apenas se o Participante deseja efetuar a liquidação financeira através do Banco Liquidante Secundário.
Modalidade	Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade e Bruta. Modalidade na qual a operação será liquidada financeiramente.

Dados da Operação – Campos de preenchimento obrigatório.

Quantidade	Quantidade do ativo a ser antecipado.
Preço Unitário	Preço unitário pactuado com a Contraparte.

Dados Complementares - Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.

Reserva Técnica	Caixa de seleção com as opções: EM BRANCO e DESVINCULAR.
-----------------	--

Campo	Descrição
Data op. Original	<p>Data da operação de Vinculação em Reserva Técnica.</p> <p>Pode ser consultada no módulo de Operações item Consultas, função Consulta Operações Futuras, em Data da Inclusão ou no item Lançamento, função Manutenção de Operações Futuras, em Data op. Original.</p>
Número Oper. Cetip	<p>Nº de controle dado automaticamente quando efetuada a vinculação em Reserva Técnica.</p> <p>Pode ser consultado no módulo de Operações, item Consultas, função Consulta Operações Futuras, em Num Ctrl Operação ou no item Lançamento, função Manutenção de Operações Futuras, em Número Cetip.</p>
CPF/CNPJ (Cliente)	<p>Identificação do participante, quando Contraparte ou Participante for conta de cliente 1 ou 2.</p> <p>O CPF ou CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.</p> <p>Caso não esteja cadastrado no SIC, a operação ficará com status Pendente de Especificação.</p>
Natureza (Cliente)	<p>Identificação do participante como Pessoa Jurídica ou Pessoa Física, quando Contraparte ou Participante for conta de cliente 1 ou 2.</p> <p>Deve ser indicado se o campo CNPJ/CPF (Cliente) for preenchido.</p>
Posição Origem – Bloqueio Judicial	<p>Campo de preenchimento obrigatório, apresentado somente quando na tela de filtro o campo Motivo for igual a Ordem Judicial.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Vazio e Sim.</p> <p>A indicação do campo será possível somente se houver posição de custódia na carteira Bloqueio Judicial.</p>
Num. Cetip Op. Original – Bloqueio Judicial	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver.</p> <p>Dado complementar da Posição Origem – Bloqueio Judicial. Preencher quando a opção for igual a “Sim”. Este número pode ser consultado no módulo Títulos e Valores Mobiliários, menu Consultas, função Instrumento Financeiros em Garantia / Margem / Bloqueio / Transferência INSS.</p>

Compra/Venda Definitiva/Cessão

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Compra/Venda Definitiva/Cessão

Visão Geral

Esta função permite o registro de uma operação de Compra/Venda definitiva de um COE. A negociação pode ser efetuada com quantidade total ou parcial, conforme a forma de registro do ativo negociado.

O COE deve estar na posição **Própria Livre** do vendedor para que a operação seja efetuada. Para consultar a posição de custódia, acesse o módulo **Custódia**, item de menu **Consultas**, função **Posição de Custódia**.

Para o registro de operação de Compra/Venda definitiva, devem ser obedecidas as regras em relação à modalidade de liquidação permitida, bem como os horários definidos.

Tela Operação de Compra/Venda Definitiva/Cessão

Operação de Compra/Venda Definitiva			
Dados da Compra/Venda Definitiva			
Tipo do IF COE	Código do Contrato <input type="text"/>	IF Inadimplente/Com Restrição <input type="text"/>	Ciência da Liquidação Antecipada <input type="text"/>
Parte		Contraparte	
Papel <input type="text"/>	Código <input type="text"/>	Meu Número <input type="text"/>	Número da Associação <input type="text"/>
Liquidação Financeira		Dados da Operação	
Liquidante <input type="text"/>	Modalidade SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO	Quantidade <input type="text"/>	P.U. <input type="text"/>
Dados Complementares			
Reserva Técnica <input type="text"/>	Data op.Original <input type="text"/>	Número Oper. CETIP <input type="text"/>	
CPF/CNPJ (Cliente) <input type="text"/>	Natureza (Cliente) <input type="text"/>	Posição Origem <input type="text"/>	
Num. Cetip Op. Original - Bloqueio Judicial <input type="text"/>	Data Liquidação <input type="text"/>		
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Descrição dos Campos da tela Operação de Compra/Venda Definitiva/Cessão

Campo	Descrição
Dados da Compra/Venda Definitiva/Cessão - Campos de preenchimento obrigatório.	
Tipo	COE.
Código IF	Código do COE objeto da operação.
IF com restrição	Não utilizado.
Ciência de Liquidação Antecipada	Não utilizado.

Campo	Descrição
Parte e Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório, exceto o campo Número da Associação.	
Papel	Caixa de seleção com as opções: Vendedor e Comprador.
Código	Código Cetip do Participante que está efetuando o lançamento (Emissor ou Detentor).
Meu Número	Número da operação de resgate.
Número da Associação	Número de associação da intermediação. Deve ser preenchido quando o tipo de conta do participante for 69 .
Código	Código Cetip da Contraparte na operação (Emissor ou Detentor).
Liquidação Financeira - Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Liquidante	Deve ser preenchido apenas se o Participante deseja efetuar a liquidação financeira através do Banco Liquidante Secundário.
Modalidade	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Sem modalidade e Bruta. Modalidade na qual a operação será liquidada financeiramente.
Dados da Operação – Campos de preenchimento obrigatório.	
Quantidade	Quantidade do ativo a ser antecipado.
P.U.	Preço unitário pactuado com a Contraparte.
Dados Complementares - Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
Reserva Técnica	Caixa com as opções: EM BRANCO, VINCULAR e DESVINCULAR.
Data op. Original	Data da operação de Vinculação em Reserva Técnica. Pode ser consultada no módulo de Operações item Consultas, função Consulta Operações Futuras, em Data da Inclusão ou no item Lançamento, função Manutenção de Operações Futuras, em Data op. Original.
Número Oper. Cetip	Nº de controle dado automaticamente quando efetuada a vinculação em Reserva Técnica. Pode ser consultado no módulo de Operações, item Consultas, função Consulta Operações Futuras, em Num Ctrl Operação ou no item Lançamento, função Manutenção de Operações Futuras, em Número Cetip.

Campo	Descrição
CPF/CNPJ (Cliente)	Identificação do participante, quando Contraparte ou Participante for conta de cliente 1 ou 2. O CPF ou CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Caso não esteja cadastrado no SIC, a operação ficará com status Pendente de Especificação.
Natureza (Cliente)	Identificação do participante como Pessoa Jurídica ou Pessoa Física, quando Contraparte ou Participante for conta de cliente 1 ou 2. Deve ser indicado se o campo CNPJ/CPF (Cliente) for preenchido.
Posição Origem – Bloqueio Judicial	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Caixa de seleção com as opções: Vazio e Sim A indicação do campo será possível somente se houver posição de custódia na carteira Bloqueio Judicial.
Num. Cetip Op. Original – Bloqueio Judicial	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Dado complementar da Posição Origem – Bloqueio Judicial. Preencher quando a opção for igual a “Sim”. Este número pode ser consultado no módulo Títulos e Valores Mobiliários, menu Consultas, função Instrumento Financeiros em Garantia / Margem / Bloqueio / Transferência INSS.
Data Liquidação	Não utilizado.

Após preencher os campos e clicar no botão Enviar, o módulo apresenta tela onde o Participante deve verificar os dados da operação, podendo confirmá-los, corrigi-los ou desistir do negócio. Se registro for confirmado é apresentada mensagem com o número do lançamento efetuado.

Quando operação confirmada, o módulo realiza atualização na posição livre do Vendedor e do Comprador, onde o comprador deverá obrigatoriamente realizar a identificação dos comitentes no SIC.

Operação de Intermediação no Mercado Secundário

A intermediação praticada no âmbito da B3 é a atividade em que um Participante atua entre as partes de uma negociação, de modo a auferir resultado financeiro positivo ou nulo, sem a assunção, relativamente às obrigações inerentes à operação, de qualquer tipo de risco de crédito, de mercado ou de liquidez.

Caracteriza-se como intermediação, a associação entre operação de compra definitiva a operação de venda definitiva de títulos, efetuada pelo Participante Intermediador, identificado pela Conta 69, com liquidação financeira pela modalidade Bruta no STR.

Observações:

- A conta de intermediação nunca apresenta posição de custódia e saldo financeiro devedor.

Lançamento de Operações

Cada intermediação é identificada por um Número de Associação. Na cadeia de intermediação, composta, obrigatoriamente, por dois Participantes Intermediadores distintos, cada um deles deve indicar um Número de Associação, nas suas operações de compra e de venda, não sendo obrigatório que referidos números sejam iguais para ambos os Intermediadores, esta operação pode ser visualizada no Módulo de Operações, função Operações não Casadas.

Após a confirmação de todas as operações, ativo será bloqueado na posição do vendedor original e status das operações serão “PENDENTE DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA”.

É permitido o estorno, por duplo comando, enquanto a operação encontrar-se com status PENDENTE DE ASSOCIAÇÃO ou PENDENTE DE LIQUIDAÇÃO FINANCEIRA.

Neste último caso, quando uma das operações da cadeia de intermediação for estornada, as demais operações são, automaticamente, estornadas pelo sistema. Os Participantes devem realizar estorno de uma operação através do Módulo de Operações, função Cancelamento de Operações.

Ao final do dia, as operações com status PENDENTE DE ASSOCIAÇÃO são rejeitadas, assumindo o status REJ: TIMEOUT LANÇAMENTO ASSOC.

Para maiores informações, veja **carta-circular n° 418** – Registro de Operações de Intermediações no Mercado Secundário.

Bloqueio/Desbloqueio de Custódia

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Bloqueio/Desbloqueio de Custódia

Visão Geral

Esta função permite que o Participante, por comando único, possa bloquear o COE em sua posição própria ou de sua conta 10 ou 20.

Para bloquear custódia que esteja em conta 10 ou 20, é obrigatório que a posição tenha sido identificada no SIC – **Módulo de Identificação de Comitentes**, para os ativos que não estão habilitados para Identificação, o bloqueio não será possível pelo participante, somente por solicitação a B3, através do e-mail **opesp@b3.com.br**

É necessário que o COE esteja com situação **Confirmada** e em posição de custódia do participante Detentor.

A operação de bloqueio pode ser consultada no módulo de **Operações**, em **Consulta Operações**.

A posição própria do participante pode ser consultada no módulo **Custódia**, em **Consulta Posição de Custódia** e os COEs bloqueados podem ser consultados no módulo Título e Valores Mobiliários em **Consulta Instrumento Financeiro em Garantia/Margem/Bloqueio**.

Para desbloqueio de custódia é necessário entrar em contato com a B3, através do e-mail **opesp@cetipb3.com.br**

Tela Bloqueio/Desbloqueio de Custódia

Bloqueio/Desbloqueio de Custódia		
Instrumento Financeiro		
Tipo COE	Código IF	<input type="text"/>
Solicitante		Detentor
Código <input type="text"/>	Meu Número <input type="text"/>	Código Detentor <input type="text"/>
Quantidade <input type="text"/>	Protocolo da Ordem de Bloqueio <input type="text"/>	
Tipo <input type="text"/>	Tipo de Bloqueio Judicial <input type="text"/>	Num. Cetip Op. Original <input type="text"/>
Número do Processo <input type="text"/>	Vara <input type="text"/>	
Motivo <input type="text"/>		
Dados Complementares		
CPF/CNPJ (Cliente) <input type="text"/>	Natureza (Cliente) <input type="text"/>	Código cliente para operações por conta e ordem <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>		

Descrição dos campos da Tela de Bloqueio/Desbloqueio de Custódia

Campo	Descrição
Instrumento Financeiro – Campo de preenchimento Obrigatório.	
Código IF	Código do COE utilizado na operação.
Solicitante e Detentor – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Código	Código do Solicitante.
Meu Número	Número da operação de bloqueio.
Código Detentor	Código Cetip do Detentor do COE.
Quantidade	Campo de preenchimento Obrigatório. Quantidade COE a ser bloqueada
Protocolo da Ordem de Bloqueio	Campo de preenchimento opcional, com até 20 (vinte) caracteres. Número de protocolo da ordem de bloqueio judicial recebida via sistema Bacenjud.
Tipo	Campo de preenchimento Obrigatório. Caixa de seleção com as opções: Bloquear e Desbloquear.
Tipo de Bloqueio	Campo de preenchimento obrigatório. Motivo do Bloqueio, Caixa de seleção com as opções Judicial, Solicit. Participante e Outros.
Num. Cetip Op. Original	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Número Cetip Operação Original
Número do Processo	Campo de preenchimento opcional, habilitado apenas para Tipo de Bloqueio “Judicial”
Vara	Campo de preenchimento opcional, habilitado apenas para Tipo de Bloqueio “Judicial”
Motivo	Campo de preenchimento obrigatório. Descrever o motivo do bloqueio.
Dados Complementares – Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	

Campo	Descrição
CPF/CNPJ (Cliente)	O CPF ou CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC. Identificação do participante, quando Contraparte ou Participante for conta de cliente 1 ou 2.
Natureza (Cliente)	Identificação do participante como Pessoa Jurídica ou Pessoa Física, quando Contraparte ou Participante for conta de cliente 1 ou 2.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o Registrador confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número do lançamento efetuado.

Bloqueio/Desbloqueio de Custódia			
Instrumento Financeiro			
Tipo COE	Nome do Tipo IF	Certificado de Operações Estruturadas	Código IF TH0713J04T4
Registrador 05000.40-7		RIOBM	
Data de Emissão 23/10/2013		QUARTA-FEIRA	
Data de Vencimento 25/10/2013		SEXTA-FEIRA	
Solicitante		Detentor	
Código	RIOBM	Meu Número	Código Detentor 05000.00-5
05000.00-5		123	RIOBM
Dados da Operação de bloqueio/desbloqueio de custódia			
Quantidade	300	Tipo BLOQUEAR	Tipo de Bloqueio Judicial
Num. Cetip Op. Original			
Motivo Pagamento de dívidas			
Dados Complementares			
CPF/CNPJ (Cliente)		Natureza (Cliente)	



Lançamento 2013102410836597 efetuado

Cancelamento de Operação

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Cancelamento de Operação

Visão Geral

Esta função permite o cancelamento de uma operação de COE, podendo ser cancelada apenas no dia da realização da operação.

Obs.: Não é possível cancelar operação de lançamento de PU na operação de resgate com status finalizada na sem modalidade.

Tela Cancelamento de Operações

Cancelamento de Operações					
Dados da Operação de Cancelamento			Dados da Operação Original		
Participante	Meu número		Num. Cetip Op. Original	Instrumento Financeiro	Contraparte
<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/>		<input type="button" value="Limpar Campos"/>		<input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela de Cancelamento de Operações

Campo	Descrição
Dados da Operação de Cancelamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Participante	Código Cetip do participante.
Meu número	Número da operação de cancelamento.
Dados da Operação Original – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Num. Cetip Op. Original	Número Cetip Operação Original.
Instrumento Financeiro	COE.
Contraparte	Código Cetip da contraparte.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número do cancelamento efetuado.

Atualização de PU

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Atualização de PU

Visão Geral

Essa função possibilita ao emissor do Instrumento Financeiro atualizar o Preço Unitário dos respectivos COEs por ele emitido.

O lançamento poderá ser sobreposto dentro na janela bilateral até o fechamento da grade, e poderá ser cancelado na janela bruta antes de efetuada a liquidação financeira. Na janela bruta, o lançamento poderá ser sobreposto apenas com o cancelamento da operação lançada.

Esta função permite os seguintes tipos/motivos de atualização:

1. Valor Inicial Ativo Subjacente

Deve ser usada quando o COE tem início à Termo e/ou quando o campo “Proteção contra Proventos” estiver registrado com a opção “Sim - Ajustado pelo Emissor”. Por meio desse tipo de atualização é possível alterar o campo “Valor Inicial do Ativo Subjacente” e o campo “Quantidade 1” (para as figuras que tem esse campo).

2. PU para COE simplificado

Deve ser utilizado para informar o PU quando o COE torna-se não-calculado pela B3. Mais informações sobre os motivos que podem tornar um certificado não-calculado estão disponíveis na seção “COE Simplificado”. Caso o COE tenha um remunerador VCP a atualização de **PU para COE simplificado** deverá ser única, não sendo necessária a atualização individual do Derivativo e do Remunerador.

3. Remunerador no vencimento

Deve ser utilizado para a atualização do Remunerador no vencimento. Nesta atualização será necessário que o Emissor informe o Fator de Correção e o Fator de Juros correspondente. Quando o campo “Remunerador no vencimento” for preenchido com “IPCA VCP”, “IBOVESPA VCP”, “PRÉ LIN/360 + VC USD” ou “USD VCP”.

4. Cotação para Fixing

Deve ser usado quando não houver captura automática do preço do ativo subjacente ou quando a captura automática não ocorrer por eventuais atrasos ou extinção do ativo subjacente.

5. PU para Knock-out no ATO

Deve ser usado para informar o PU do COE quando for atingida a barreira de Knock-out (rebate). Caso não haja captura automática de preço do ativo-subjacente, o atingimento da barreira deve ser informada na função “Indicação de Disparo de Trigger”.

6. Fator Path Dependent

Deve ser usado para informar o fator de correção do remunerador para as figuras com a característica de *path dependent* cujo ativo-subjacente não seja capturado de forma automática pela B3.

7. Ajuste Valor de Referência.

Por meio desse tipo de atualização é possível alterar o campo “Valor Inicial do Ativo Subjacente” e o campo “Quantidade 1” (para as figuras que tem esse campo).

A atualização por esse motivo só é possível até D+3 do registro e pode ser utilizada em todas as classes de ativo subjacente disponíveis.

8. Valores Lookback

Deve ser usado para se atualizar o Valor Inicial do ativo-subjacente, pelo motivo da verificação de “lookback”. Está disponível apenas para emissões que tiveram o campo "Lookback" preenchido com “Sim”.

9. Valores Ativo Subjacente Fluxo de Caixa

Deve ser utilizado para atualização do valor do ativo-subjacente nas datas de evento do fluxo de caixa. O valor informado será utilizado para verificar se houve atingimento das barreiras de cupom e/ou de chamada.

Essa atualização é necessária quando as cotações do ativo-subjacente não forem capturadas automaticamente pela B3.

10. Remunerador no Fluxo

Deve ser utilizado para a atualização do Remunerador do Fluxo de Caixa.

Nesta atualização será necessário que o Emissor informe o Fator de Correção e o Fator de Juros

Deve ser usado quando o campo “Remunerador no Fluxo” for preenchido com “IPCA VCP” ou “USD VCP”.

Tela Filtro Atualização de PU de um COE

> Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Atualização de PU

Atualização de PU de um COE

Conta Emissora 05000 .40 -7

Código IF TH0119H7WVJ

Tipo Atualização Valor Inicial Ativo Subjacente

Confirmar Limpar Campos Desistir

Descrição dos campos da Tela Filtro Atualização de PU de um COE

Campo	Descrição
Atualização de PU de um COE – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Conta Emissora	Código da conta emissora.

Campo	Descrição
Código IF	Código Cetip do COE.
Tipo de Atualização	✓ Caixa de seleção com as opções: Valor Inicial do Ativo Subjacente, Cotação para Fixing, PU para COE simplificado, Remunerador no Vencimento, PU para Knock-out no ATO, e Fator Path Dependent, Valores Ativo Subjacente Fluxo de Caixa, Valores Lookback, Ajuste Valor de Referência e Remunerador no Fluxo.

Tela Atualização Valor Inicial Ativo Subjacente

Atualização Valor Inicial Ativo Subjacente

Dados do Ativo

Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0119H7WVJ	Nome Fantasia TESTE
Data de Emissão 15/08/2019	Data de Vencimento 14/08/2020
Data da Última Atualização PU 15/08/2019	

Dados para Lançamento

Data da Atualização <input style="width: 100%;" type="text"/>	Valor Inicial do Ativo Subjacente <input style="width: 100%;" type="text"/>
Quantidade 1 <input style="width: 100%;" type="text"/>	

Descrição dos campos da Tela: Atualização Valor Inicial Ativo Subjacente

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data da Atualização	Data da atualização.

Campo	Descrição
Valor Inicial do Ativo Subjacente	Campo de preenchimento Obrigatório, quando o COE for Registrado à Termo e o campo "Proteção contra Proventos" estiver marcado com a opção "Sim - Ajustado pelo Emissor".
Quantidade 1	Campo de preenchimento Opcional, quando o COE for Registrado à Termo e o campo Proteção contra Proventos estiver marcado com a opção "Sim - Ajustado pelo Emissor". Indica a quantidade de opções que deve ser considerada no cálculo do COE.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número da Operação **Atualização Valor Inicial Ativo Subjacente**.

Tela Atualização PU do Contrato

Atualização de PU de um COE	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0713J050J	Nome Fantasia Straddle_20131024_Cen2
Data de Emissão 24/10/2013	Data de Vencimento 28/10/2013
Data da Última Atualização PU 24/10/2013	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização 24 / 10 / 2013	Valor PU 1000 ,
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Filtro Atualização de PU de um COE

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data da Atualização	Data da atualização.
Valor PU	Valor do PU.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número da Operação **Atualização de PU**.

Tela Atualização Remunerador no Vencimento

Atualização Remunerador no Vencimento	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0119J7X8U	Nome Fantasia Teste Tozato - VCP
Data de Emissão 23/10/2019	Data de Vencimento 23/10/2020
Data da Última Atualização PU 23/10/2019	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização <input type="text"/>	Fator de Juros <input type="text"/>
Fator de Correção de Remuneração <input type="text"/>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Filtro Atualização Remunerador

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data da Atualização	Data da atualização.
Fator de Correção de Remunerador	Fator de correção. 12 Inteiros e 8 Decimais
Fator de Juros	Fator de Juros. 12 Inteiros e 8 Decimais

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número da Operação **Atualização Remunerador**.

Tela Atualização Cotação para Fixing

Atualização Cotação para Fixing	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0114G658U	Nome Fantasia t
Data de Emissão 08/07/2014	Data de Vencimento 08/07/2015
Data da Última Atualização PU 08/07/2014	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização 6 / 7 / 2015	Valor do Ativo Subjacente 10000 ,
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Atualização Cotação para Fixing

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data Atualização	Data da atualização.
Valor do Ativo Subjacente	Valor do Ativo Subjacente.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número da Operação **Atualização Cotação para Fixing**.

Tela Atualização Fator Path Dependent

Atualização Fator Path Dependent	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH1515C6TTX	Nome Fantasia Teste1
Data de Emissão 03/03/2015	Data de Vencimento 06/03/2015
Data da Última Atualização PU 03/03/2015	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização 5 / 3 / 2015	Fator de Correção de Remuneração 5 ,
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Atualização Fator Path Dependent

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data da Atualização	Data em que a atualização é feita.
Fator de Correção de Remuneração	Fator de correção. 12 Inteiros e 8 Decimais

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número da Operação **Atualização Fator Path Dependent**.

Tela Atualização PU para Knock out no ATO

Atualização PU para Knock out no ATO	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0315C6UC6	Nome Fantasia TesteUltimate
Data de Emissão 09/03/2015	Data de Vencimento 12/03/2015
Data da Última Atualização PU 10/03/2015	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização 10 / 3 / 2015	Valor PU 1047 , 74000000
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Atualização PU para Knock out no ATO

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data da Atualização	Data em que a atualização é feita.
Valor PU	Valor do PU.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número da Operação **Atualização PU para Knock out no ATO**.

Tela Atualização Ajuste Valor Referência

Atualização Ajuste Valor Referência	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0715E6ZAF	Nome Fantasia novo
Data de Emissão 12/05/2015	Data de Vencimento 12/05/2016
Data da Última Atualização PU 12/05/2015	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização 12 / 05 / 2015	Valor Inicial do Ativo Subjacente 10000 ,
Quantidade 1 ,	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Atualização Ajuste Valor Referência

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data da Atualização	Data em que a atualização é feita. A atualização é permitida somente até D+3 ao dia do registro.
Valor Inicial do Ativo Subjacente	Novo valor inicial do ativo subjacente. Formato: 12 inteiros e 8 decimais.
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento Opcional quando o COE for Registrado à Termo e o campo Proteção contra Proventos estiver marcado com a opção "Sim - Ajustado pelo Emissor".</p> <p>Indica a quantidade de opções que deve ser considerada no cálculo do COE</p>

Tela Atualização Ajuste Valor Referência (com cesta)

Atualização Ajuste Valor Referência	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0116G7N1Q	Nome Fantasia Teste_Call_Cesta
Data de Emissão 27/07/2016	Data de Vencimento 27/07/2017
Data da Última Atualização PU 27/07/2016	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização <input type="text"/> / <input type="text"/> / <input type="text"/>	
Código do Ativo Subjacente BBAS3	Valor Inicial do Ativo Subjacente <input type="text"/> , <input type="text"/>
Código do Ativo Subjacente ITUB4	Valor Inicial do Ativo Subjacente <input type="text"/> , <input type="text"/>
Código do Ativo Subjacente CHUMBO	Valor Inicial do Ativo Subjacente <input type="text"/> , <input type="text"/>
Quantidade 1 <input type="text"/> , <input type="text"/>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Tela Atualização Valores Lookback

Atualização Valores Lookback	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 10020.40-3	Nome Simplificado do Emissor LEMEBM
Código IF LE0115F74VO	Nome Fantasia TESTE
Data de Emissão 25/06/2015	Data de Vencimento 27/07/2015
Data da Última Atualização PU 25/06/2015	
Dados para Lançamento	
Data de Lookback 25/06/2015	Data de Referência Lookback <input type="text"/> / <input type="text"/> / <input type="text"/>
	Valor Inicial do Ativo Subjacente Lookback <input type="text"/> , <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Atualização Valores Lookback

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data de Referência Lookback	Data Base Referência utilizado pelo Participante para Novo Valor Inicial do Ativo Subjacente. Campo no formato DD/MM/AAAA.
Valor Inicial do Ativo Subjacente Lookback	Campo numérico com 12 inteiros e 8 decimais.

Observação:

Uma vez lançado o valor inicial do Ativo Subjacente Lookback, o COE passará a ser simplificado. Necessitando, desta forma, da atualização de PU no vencimento. Caso não haja o lançamento do valor inicial do Ativo Subjacente Lookback, o COE permanecerá calculado e o valor inicial do ativo subjacente não será substituído.

Tela Atualização Valor Ativo Subjacente para Fluxo de Caixa

Atualização Valor Ativo Subjacente para Fluxo de Caixa	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 10020.40-3	Nome Simplificado do Emissor LEMEBM
Código IF LE0115F74VQ	Nome Fantasia TESTE1
Data de Emissão 25/06/2015	Data de Vencimento 30/06/2015
Data da Última Atualização PU 25/06/2015	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização <input type="text"/>	Valor do Ativo Subjacente <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Atualização Valor Ativo Subjacente para Fluxo de Caixa

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data de Atualização	Data em que a atualização é feita. A atualização é permitida em todas as datas.
Valor do Ativo Subjacente	Valor do Ativo Subjacente.

Tela Atualização Remunerador Fluxo de Caixa

Remunerador Fluxo de Caixa	
Dados do Ativo	
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Código IF TH0118H7UPS	Nome Fantasia Teste
Data de Emissão 31/08/2018	Data de Vencimento 02/09/2019
Data da Última Atualização PU 31/08/2018	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização <input type="text"/>	Fator de Correção <input type="text"/>
Fator de Juros <input type="text"/>	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Remunerador Fluxo de Caixa

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Data de Atualização	Data em que a atualização é feita. A atualização é permitida para datas anteriores ou igual a data da atualização. Não aceita finais de semana
Fator de Correção	Indicar o Fator de Correção. Campo com 12 inteiros e 8 decimais Ver item 53 no caderno de fórmulas
Fator de Juros	Indicar o Fator de Juros Campo com 12 inteiros e 8 decimais Ver item 53 no caderno de fórmulas

Indicação de Disparo de Trigger

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Indicação de Disparo de Trigger

Visão Geral

Essa função permite que os COEs sejam marcados quanto ao disparo de Trigger (In e Out).

O sistema permite que COEs que sigam as seguintes premissas sejam passíveis de atualização:

- ✓ Os COEs devem estar registrados no sistema;
- ✓ Só podem ter a possibilidade de Indicação de Rebate (**na função Atualização de PU** – motivo “PU para Knock-out no Ato”) os ativos em que houve o disparo do trigger out;
- ✓ Esta função serve para indicar se houve disparo de Trigger In e Trigger Out (somente no caso do Trigger Out pode ser indicado o valor do Rebate).

Observação: Caso o ativo subjacente seja não capturado, não haverá disparo automático de barreiras, nem mesmo com a indicação de valor do ativo subjacente no vencimento do COE. Neste caso, a funcionalidade “Indicação de Disparo de Trigger” deve ser utilizada para informar o atingimento das barreiras.

Tela Lançamento de Indicação de Disparo de Trigger - COE

Lançamento de Indicação de Disparo de Trigger - COE

Conta Emissora

Código IF

Descrição dos campos da Tela Lançamento de Indicação de Disparo de Trigger - COE

Campo	Descrição
Conta Emissora	Campo de preenchimento Obrigatório.
Código IF	Campo de preenchimento Obrigatório. Código do COE.

Tela Lançamento de Indicação de Disparo de Trigger - COE

Lançamento de Indicação de Disparo de Trigger - COE	
Dados do Contrato	
Código IF TH0914A2LEV	Data de Vencimento 08/01/2014
Conta Emissora 05000.40-7	Nome Simplificado do Emissor RIOBM
Dados para Lançamento	
Data de atualização 08/01/2014	Tipo de disparo OUT ▼
Data do disparo 06 / 01 / 2014	Valor do Ativo Subjacente 10000 × ,
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Lançamento de Indicação de Disparo de Trigger - COE

Campo	Descrição
Dados para Lançamento – Campos de preenchimento Obrigatório.	
Tipo de disparo	Caixa de seleção com as opções: IN e OUT, IN ou OUT (depende do Tipo do COE).
Data do disparo	Deve ser menor ou igual à data de processamento.
Valor do Ativo Subjacente	Valor do ativo subjacente.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o número de que a Operação de Lançamento de Indicação de Disparo de Trigger foi Registrada com Sucesso.

Atualização de Valores de Notional (“Análise de Sensibilidade”)

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Atualização de Valores de Notional

Visão Geral

Esta função possibilita que o Emissor indique somente os percentuais de **Notional Mínimo** e **Notional Máximo** e **Fator de Risco**, conforme definição abaixo. Esta função deve ser utilizada para o informe mensal do resultado da análise de sensibilidade.

Nos registros e atualizações de Notional, o Emissor é responsável pelo seu lançamento e informações prestadas e pode informar quantos Notional Mínimo e Máximo forem necessários, até o final da grade de registro sem modalidade, permanecendo válido o último informado.

Observação:

As informações de Notional devem obedecer a seguinte regra:

> A atualização de Valores de Notional deve ser realizada mensalmente até o 3º dia útil do mês subsequente.

Tela Registro de Valores de Notional - COE

Registro de Valores de Notional - COE

Código IF

Após preencher o código do COE e confirmar, o sistema envia a tela abaixo.

Registro de Valores de Notional - COE

Código IF
TH0114A3ACW

Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 1 ,

Valor Notional Máximo (%) - Cenário 1 ,

Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 2 ,

Valor Notional Máximo (%) - Cenário 2 ,

Fator de Risco

Data Refer. Atualização / /

Descrição dos campos da Tela Registro de Valores de Notional - COE

Campo	Descrição
-------	-----------

Todos os campos são de preenchimento obrigatório.

Campo	Descrição
Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 1	O emissor deve preencher o percentual (a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão) do valor de mercado do COE após choque de BAIXA de - 50 bps anuais ou - 5% no ativo subjacente.
Valor Notional Máximo (%) - Cenário 1	O emissor deve preencher o percentual (a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão) do valor de mercado do COE, após choque de ALTA de + 50 bps anuais ou + 5% no ativo subjacente.
Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 2	O emissor deve preencher o percentual (a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão) do valor de mercado do COE, após choque de BAIXA de - 200 bps anuais ou - 20% no ativo subjacente.
Valor Notional Máximo (%) - Cenário 2	O emissor deve preencher o percentual (a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão) do valor de mercado do COE, após choque de ALTA de + 200 bps anuais ou + 20% no ativo subjacente.
Fator de Risco	Indicar o principal ativo objeto de referência no COE. Trata-se do Ativo que serão dados os choques.
Data Refer. Atualização	Data de referência do cálculo do Notional preenchido nesta função.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem **Notional Atualizado com Sucesso**.

Garantia

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Garantia

Visão Geral

Esta função permite ao Garantidor efetuar a vinculação do COE registrado na B3, para Conta de Garantia (Conta 60), de um Participante Garantido, a fim de assegurar operações entre eles.

Os ativos são vinculados pelos Participantes, sempre com duplo comando do Garantido e do Garantidor. A operação pode ser cancelada, desde que no próprio dia do lançamento, no Módulo de Operações.

Os Participantes podem optar por dois tipos de garantia: Penhor ou Cessão Fiduciária.

As Partes devem indicar a quem são atribuídos os créditos referentes aos títulos dados em garantia na ocorrência de eventos, se ao Garantidor ou ao Garantido, através do campo: Direitos p/ Garantidor.

Ao preencher os campos Direitos p/ Garantidor e Tipo de Garantia, os Participantes devem ter ciência das seguintes regras de funcionamento:

Tipo de Garantia	Direitos para Garantidor	Regra
Penhor	Sim	Os eventos de Juros, Juros Sobre Parcela Amortizada e Pagamento de Rendimento são direcionados para o Garantidor. Já os eventos de Amortização / Resgate são gerados para o Garantido.
Penhor	Não	Todos os eventos são direcionados ao Garantido.
Cessão Fiduciária	Sim	Todos os eventos são direcionados ao Garantidor.
Cessão Fiduciária	Não	Todos os eventos são direcionados para o Garantido.

Tela Garantia COE

Garantia			
Instrumento Financeiro			
Tipo	Código IF	IF com restrição	
COE	<input type="text"/>	<input type="text" value="v"/>	
Parte		Contraparte	
Papel	Código	Meu Número	Código
<input type="text" value="v"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>	<input type="text"/>
Dados da Operação de Garantia			
Quantidade	Direitos p/ Garantidor	Tipo de Garantia	
<input type="text"/>	<input type="text" value="v"/>	<input type="text" value="v"/>	
Dados Complementares			
CPF/CNPJ (Cliente)	Natureza (Cliente)		
<input type="text"/>	<input type="text" value="v"/>		
<input type="button" value="Enviar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/>	<input type="button" value="Desistir"/>	

Após preencher os campos e clicar no botão Enviar, o módulo apresenta tela onde o Participante deve verificar os dados da operação, podendo confirmá-los, corrigi-los ou desistir do negócio. Se o registro for confirmado é apresentada mensagem com o número do lançamento efetuado.

Descrição dos Campos da Tela Garantia

Campos	Descrição
Instrumento Financeiro – Campo de preenchimento obrigatório, exceto o campo IF com restrição.	
Código IF	Código do instrumento financeiro
IF com restrição	<p>Informa se o instrumento financeiro a ser vinculado em conta garantia está inadimplente ou não.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Sim ou em branco.</p>
Parte e Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório.	
Papel	<p>Indicar o Participante que está lançando a operação.</p> <p>Caixa de seleção com as opções: Garantidor e Garantido</p>
Código	Código Cetip (conta 60) do Garantidor ou do Garantido.
Meu número	<p>Número desta operação.</p> <p>Não é obrigatório que Parte e Contraparte informem o mesmo número.</p>
Código	Código Cetip (conta 60) do Garantidor ou do Garantido, Contraparte na operação.
Dados da Operação de Garantia - Campos de preenchimento obrigatório.	
Quantidade	Quantidade do instrumento financeiro a ser transferido para conta de garantia.
Direitos p/ Garantidor	<p>Caixa de seleção com as opções: Sim ou Não.</p> <p>Indica se os créditos referentes aos títulos dados em garantia na ocorrência de eventos são atribuídos ao Garantidor.</p> <p>Caso a opção escolhida seja Não, os créditos são atribuídos ao Garantido.</p>
Tipo de Garantia	Indicar o tipo de garantia. Caixa de seleção com as opções: Cessão Fiduciária ou Penhor.
Dados Complementares - Campos de preenchimento obrigatório, quando houver.	
CPF/CNPJ (cliente)	Preencher se Parte ou Contraparte Cliente1 ou Cliente2. O CPF ou CNPJ deve estar previamente cadastrado no SIC.
Natureza (cliente)	Caixa de seleção com as opções: PJ e PF. Deve ser indicado se o campo CPF/CNPJ (Cliente) for preenchido.

Cancelamento Retroativo de Operação de Depósito

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Cancelamento Retroativo de Depósito

Visão Geral

Essa função permite somente ao emissor do COE o cancelamento retroativo da operação de Depósito em casos da contraparte ser o Cliente 1 do próprio emissor em até D+2 da data de registro da operação de depósito.

Tela Cancelamento Retroativo da Operação de Depósito

Cancelamento Retroativo de Depósito	
Dados da Operação de Cancelamento	
Participante	<input type="text"/>
Instrumento Financeiro	<input type="text"/>
Contraparte	<input type="text"/>
Num. Cetip Op. Original	<input type="text"/>
Meu número	<input type="text"/>
Data op. original	<input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Cancelamento Retroativo da Operação de Depósito

Campo	Descrição
Todos os campos são de preenchimento obrigatório.	
Participante	Código Cetip do participante. Conta tipo 40 (emissor).
Instrumento Financeiro	Código Cetip do Instrumento Financeiro
Contraparte	Código Cetip da contraparte da operação.
Num. Cetip Op. Original	Número Cetip Operação Original
Meu número	Número do lançamento.
Data op. original	Data da operação original do depósito.

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o sucesso da operação.

Indicação de Entrega Física

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Indicação de Entrega Física

Visão Geral

Essa função permite somente ao emissor do COE o lançamento da Indicação de Entrega Física para os COEs registrados com esta característica. A Indicação deve ser feita no vencimento do COE e o Emissor indicará o quanto será liquidado em BRL e o quanto será entregue do Ativo Subjacente.

O sistema permite a Entrega Física apenas para operação **012 – resgate no vencimento**. Para as operações **014 – resgate antecipado** e **314 – resgate retroativo** sistema possibilita somente o resgate com financeiro.

Tela de Indicação de Entrega Física

Descrição dos campos da Tela Cancelamento Retroativo da Operação de Depósito

Campo	Descrição
Conta Emissora	Campo de preenchimento Obrigatório.
Código IF	Campo de preenchimento Obrigatório. Código do COE.

Tela de Lançamento de Indicação de Entrega Física

Lançamento de Indicação de Entrega Física	
Dados do Contrato	
Código IF	Data de Vencimento
TH0115E6Z80	08/05/2015
Conta Emissora	Nome Simplificado do Emissor
05000.40-7	RIOBM
Dados para Lançamento	
Valor do PU para Entrega Física	<input type="text"/> , <input type="text"/>
Valor do PU para Resgate	<input type="text"/> , <input type="text"/>
<input type="button" value="Enviar"/>	<input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>

Descrição dos campos da Tela Cancelamento Retroativo da Operação de Depósito

Campo	Descrição
Todos os campos são de preenchimento obrigatório.	
Valor do PU para Entrega Física	PU que representará o valor que será entregue em Ativos Subjacente
Valor do PU para Resgate	PU que indicará o valor que será liquidado em BRL

Após clicar no botão **Enviar** é apresentada tela para confirmação dos dados. Se o participante confirmar a operação, é apresentada mensagem informando o sucesso da operação.

Manutenção do Código ISIN

Menu Títulos e Valores Mobiliários > Instrumento Financeiro > Manutenção de Código ISIN

Visão Geral

Função disponível para COE.

Permite que o Registrador informe o código que identifica uma emissão específica de título e valor mobiliário, conforme a norma ISO 6166.

Pode ser incluído no mesmo dia do registro e até a véspera data de vencimento. Cabe aos respectivos emissores e registradores a solicitação do referido código ISIN junto à B3 segmento Listado.

Tela Manutenção de Código ISIN

Manutenção de Código ISIN	
Instrumento Financeiro	
Tipo	COE
Código IF	TH0115F74VS
Código ISIN	BRAAAABBBM6
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Manutenção de Código ISIN

Campo	Descrição
-------	-----------

Campos de preenchimento obrigatório.

Tipo	Tipo do instrumento financeiro
Código IF	Código do instrumento financeiro
Código ISIN	Código ISIN – <i>International Securities Identification Number</i> . Ao ser informado, a aplicação retornará todos os títulos ou valores mobiliários que tenham o código ISIN indicado. Quando o código informado for inválido, a aplicação retorna mensagem “ <i>Não existem valores para o filtro informado</i> ”.

Manutenção de Código ISIN			
Instrumento Financeiro			
Tipo COE	Nome do Tipo IF	Certificado de Operações Estruturadas	Código IF TH0115F74VS
Registrador/Emissor 05000.40-7	Nome Simplificado do Registrador/Emissor	RIOBM	IF Inadimplente NÃO
Data Emissão 26/06/2015		SEXTA-FEIRA	
Data Vencimento 20/03/2018		TERÇA-FEIRA	
Código ISIN BRAAAABBBM6			
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Código ISIN do Instrumento Financeiro TH0115F74VS alterado com sucesso

Parametrização de Cestas

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Parametrização de Cestas

Visão Geral

Essa função permite a parametrização da CESTA, nos casos em que o COE ficar com o status PENDENTE DE CESTA.

Tela Parametrização de Cesta

Descrição dos campos da Tela Parametrização de Cesta

Campo	Descrição
Código IF	Campo de preenchimento obrigatório. Código do COE.
Manter Dados Cesta?	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Se o COE não possuir cesta a opção não deve ser preenchida.
Tipo de Cesta	Campo de preenchimento obrigatório se “Manter Dados Cesta?” for igual a “NÃO”. Não deve ser preenchido se o campo “Manter Dados Cesta?” for igual a “SIM”. Caixa com as opções: WORST OF, BEST OF, STANDARD, SPREAD, RAINBOW e MEMORIZER. Para mais informações dos tipos de Cesta, consultar a seção Cestas .
Quantidade de Ativos na Cesta	Campo de preenchimento obrigatório se “Manter Dados Cesta?” for igual a “NÃO”. Somente números inteiros, maior do que zero e máximo de 20. Não deve ser preenchido se o campo “Manter Dados Cesta?” for igual a “SIM”.

Campo	Descrição
Ação	<p>Campo de preenchimento obrigatório. Caixa com as opções:</p> <p>INCLUIR - Prossegue para a função de parametrização de cestas;</p> <p>ALTERAR – Permite alterar uma cesta já parametrizada para um COE registrado, ou seja, com o STATUS CONFIRMADO.</p> <p>O participante pode alterar uma cesta apenas se o COE não estiver com a operação de depósito finalizada.</p>

Tela Parametrização de Cesta - WORST OF ou BEST OF

Parametrização de Cesta

Ação
INCLUIR

Tipo de Cesta
WORST OF

Moeda paridade Valor inicial paridade Data Fixing Paridade

REAL , / /

Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing
<input type="text"/>	FECHAMENTO <input type="text" value="FECHAMENTO"/>	<input type="text" value=""/> , <input type="text" value=""/>	<input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/>
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing
<input type="text"/>	FECHAMENTO <input type="text" value="FECHAMENTO"/>	<input type="text" value=""/> , <input type="text" value=""/>	<input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/>
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing
<input type="text"/>	FECHAMENTO <input type="text" value="FECHAMENTO"/>	<input type="text" value=""/> , <input type="text" value=""/>	<input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/>
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing
<input type="text"/>	FECHAMENTO <input type="text" value="FECHAMENTO"/>	<input type="text" value=""/> , <input type="text" value=""/>	<input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/> / <input type="text" value=""/>

Descrição dos campos da Tela Parametrização de Cesta - WORST OF ou BEST OF

Campo	Descrição
Moeda paridade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Com os domínios: REAL, EURO/COM. EUROPEIA, LIBRA ESTERLINA, IENE E DOLAR DOS EUA.</p> <p>Paridade diferente de REAL somente pode ser escolhida se na tela de Registro/Emissão a opção QUANTO estiver selecionada como “NÃO”. E se pelo menos uma das categorias de ativo subjacente for igual: Taxa de Câmbio, Commodities, Ações Internacionais, Índices Internacionais e Juros Internacionais.</p> <p>Para opção QUANTO “SIM”, somente REAL pode ser escolhido.</p>
Valor inicial paridade	<p>Campo de preenchimento obrigatório se moeda diferente de REAL.</p> <p>Não preencher se moeda igual a REAL.</p> <p>Valor inicial de referência para o cálculo da variação da paridade da cesta.</p> <p>Campo no formato numérico com 5 inteiros e 8 decimais.</p>
Data Fixing Paridade	<p>Campo de preenchimento obrigatório se moeda diferente de REAL.</p> <p>Não preencher se moeda igual a REAL.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA.</p>
Código do Ativo Subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório. Deve ser preenchido com o código do ativo subjacente.</p> <p>Pode ser utilizado para compor cesta o ativo subjacente disponível na Consulta de Ativo Subjacente.</p> <p>Não pode compor cesta os ativos subjacentes com captura em D0.</p>
Tipo Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa com as opções: FECHAMENTO, AJUSTE, MÉDIA, MÁXIMO e MÍNIMO.</p>
Valor Inicial do Ativo Subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo no formato numérico com 12 inteiros e 8 decimais.</p>
Data Fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não pode ser maior nem igual ao vencimento. Campo no formato DD/MM/AAAA.</p>

Tela Parametrização de Cesta – STANDARD, SPREAD, MEMORIZER e RAINBOW

Parametrização de Cesta				
Ação ALTERAÇÃO				
Tipo de Cesta STANDARD				
Moeda paridade	Valor inicial paridade	Data Fixing Paridade		
<input type="text" value="DOLAR DOS EUA"/>	<input type="text" value="3"/> , <input type="text" value="07"/>	<input type="text" value="25"/> / <input type="text" value="06"/> / <input type="text" value="2015"/>		
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
<input type="text" value="COBRE"/>	<input type="text" value="FECHAMENTO"/>	<input type="text" value="13"/> , <input type="text" value=""/>	<input type="text" value="25"/> / <input type="text" value="06"/> / <input type="text" value="2015"/>	<input type="text" value="50"/> , <input type="text" value=""/>
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
<input type="text" value="CHUMBO"/>	<input type="text" value="FECHAMENTO"/>	<input type="text" value="12"/> , <input type="text" value=""/>	<input type="text" value="25"/> / <input type="text" value="06"/> / <input type="text" value="2015"/>	<input type="text" value="50"/> , <input type="text" value=""/>
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Descrição dos campos da Tela Parametrização de Cesta – STANDARD, SPREAD, MEMORIZER e RAINBOW

Campo	Descrição
Moeda paridade	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Caixa com as opções: REAL, EURO/COM. EUROPEIA, LIBRA ESTERLINA, IENE E DOLAR DOS EUA.</p> <p>Paridade diferente de REAL somente pode ser escolhida se na tela de Registro/Emissão a opção QUANTO estiver selecionada como “NÃO”. E se pelo menos uma das categorias de ativo subjacente for igual: Taxa de Câmbio, Commodities, Ações Internacionais, Índices Internacionais e Juros Internacionais.</p> <p>Para opção QUANTO “SIM”, somente REAL pode ser escolhido.</p>
Valor inicial paridade	<p>Campo de preenchimento obrigatório se moeda diferente de REAL.</p> <p>Não preencher se moeda igual a REAL.</p> <p>Valor inicial de referência para o cálculo da variação da paridade da cesta.</p> <p>Campo no formato numérico com 5 inteiros e 8 decimais.</p>
Data Fixing Paridade	<p>Campo de preenchimento obrigatório se moeda diferente de REAL.</p> <p>Não preencher se moeda igual a REAL.</p> <p>Data de referência para a captura do valor final de cada ativo subjacente que compõe a cesta. Campo no formato DD/MM/AAAA.</p>
Código do Ativo Subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Somente os ativos subjacentes disponíveis na Consulta de Ativos Subjacentes podem ser utilizados para compor cestas.</p>

Campo	Descrição
Tipo Cotação para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Caixa com as opções: FECHAMENTO, AJUSTE, MÉDIA, MÁXIMO, MÍNIMO.
Valor Inicial do Ativo Subjacente	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com formato numérico com 12 inteiros e 8 decimais; Valor inicial de referência para o cálculo da variação de cada ativo que compõe a cesta.
Data Fixing	Campo de preenchimento obrigatório. Data de referência para a captura do valor final de cada ativo subjacente que compõe a cesta. Não poderá ser maior ou igual ao vencimento. Campo no formato DD/MM/AAAA.
Peso %	Campo de preenchimento obrigatório. Campo numérico, representando um percentual. Precisão de 4 inteiros e 4 decimais. e deve ser diferente de zero. Para o tipo de cesta STANDARD os valores de “Peso (%)” devem ser positivos e o somatório correspondente dos “Pesos (%)” da cesta deve ser 100%. Para os tipos de cesta: SPREAD, MEMORIZER e RAINBOW os valores de “Peso %” devem ser diferentes de 0 (zero) e o somatório correspondente dos “Pesos (%)” da cesta podem ser positivos, negativos ou iguais a 0.

Após clicar no botão **Enviar**, aparecerá a tela para confirmação dos dados.

Parametrização de Cesta

Ação
ALTERAÇÃO

Tipo de Cesta
STANDARD

Moeda paridade	Valor inicial paridade	Data Fixing Paridade
DOLAR DOS EUA	3,07000000	25/06/2015

Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
COBRE	FECHAMENTO	13,00000000	25/06/2015	50,0000
Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
CHUMBO	FECHAMENTO	12,00000000	25/06/2015	50,0000

Após clicar no botão **Confirmar**, o sistema apresenta a mensagem abaixo:

Certificado de Operações Estruturadas 'TH0115F74V2' incluído com sucesso

Indicação de Pagamento Extraordinário

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Indicação de Pagamento Extraordinário

Visão Geral

O sistema permite a utilização da função nos seguintes casos:

- Pagamento de Cupom em moeda estrangeira;
- Pagamento de dividendos ou outros direitos corporativos corrigidos ou não por 100% do DI.
- Pagamento de Cupom em reais, quando houver condicionantes ou eventos, que não sejam verificados apenas pela condição da cotação do ativo subjacente, que poderão acarretar inclusive em não liquidação do cupom.

O Pagamento deve ser feito na data de Pagamento agendada (Fluxo ou vencimento) do COE.

Estes pagamentos estão disponíveis para as seguintes Classes de Ativo Subjacente:

- Ações Nacionais
- Ações Internacionais
- Títulos Privados Nacionais
- Títulos Privados Internacionais
- Títulos Públicos Nacionais
- Títulos Públicos Internacionais
- Índices
- Índices Internacionais
- Taxas de Câmbio
- Cesta

Tela Filtro Indicação de Pagamento Extraordinário

Filtro Lançamento de Pagamento Extraordinário

Conta Emissora

Código IF

Após preenchimento dos campos e confirmar os dados. O sistema apresenta a tela abaixo.

Tela Lançamento de Pagamento Extraordinário

Lançamento de Pagamento Extraordinário	
Dados do Contrato	
Código IF MO0115L7DWE	Data de Vencimento 22/12/2015
Conta Emissora 00684.40-2	Nome Simplificado do Emissor MOOCABM
Dados para Lançamento	
Fator Evento Extraordinário 1,05900000	
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Descrição dos campos da Tela Lançamento de Pagamento Extraordinário

Campo	Descrição
Fator Evento Extraordinário	<p>Campo de preenchimento obrigatório. E deve ser realizado para efetiva liquidação dessa operação, que é independente da liquidação do resgate do COE.</p> <p>Formato numérico com 12 inteiros e 8 decimais.</p> <p>Deve ser maior ou igual a 1 (um), quando o emissor estiver VENDIDO no Derivativo, conforme indicado no campo "Posição do Emissor no Derivativo" ou;</p> <p>Deve ser menor ou igual a 1(um) quando o emissor estiver COMPRADO no Derivativo, conforme indicado no campo "Posição do Emissor no Derivativo"</p> <p>Para mais informações sobre essa funcionalidade, consultar o Caderno de Fórmulas do COE.</p>

Após a confirmação do fator, o sistema apresenta mensagem, conforme abaixo.

Lançamento de indicação de pagamento extraordinário (2015122213125520) realizado com sucesso

Lançamento de Datas para Fixing (Mais Datas)

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Lançamento de Datas para Fixing

Visão Geral

Nesta função deverão ser incluídas as datas para fixing caso seja indicado “**MAIS DATAS**” no campo variável das figuras “Período de captura do ativo subjacente para liquidação”

Essas datas serão utilizadas para formação do *fixing* de vencimento do COE, de acordo com o que for indicado no campo “Tipo de Fixing para Vencimento” (Máximo, Mínimo ou Média)

É permitida a indicação de até 999 datas de fixing

Tela Filtro Lançamento de Datas para Fixing

 > Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Lançamento de Datas para Fixing

Lançamentos de Datas para Fixing

Conta Emissora

Código IF

Ação ▼

Manter Fluxo Atual?

Número de Datas

Após preenchimento dos campos e a confirmação dos dados, o sistema apresentará a tela abaixo.

Tela Lançamento de Datas para Fixing

> Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Lançamento de Datas para Fixing

Lançamentos de Datas para Fixing

Data Fixing

Data Fixing

Data Fixing

Campo	Descrição
Data Fixing	Campo de preenchimento obrigatório. Campo tipo Data no formato DD/MM/AAAA A data deve ser maior que a data de registro do COE, menor que a data de vencimento e não pode ser final de semana.

Após o envio das datas, o sistema apresentará a seguinte mensagem, conforme abaixo.

Certificado de Operações Estruturadas 'TH0120H7Z5H' incluído com sucesso

Vinculação de Reserva Técnica

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Vinculação de Reserva Técnica

Visão Geral

Esta função permite que o Participante, Conta Própria, efetue a vinculação de ativos registrados na B3 para a Conta de Reserva Técnica, (Conta 97).

Este depósito é mantido na conta de Reserva Técnica para garantir operações efetuadas pelos participantes Sociedades Seguradoras e outras entidades vinculadas à SUSEP (Superintendência de Seguros Privados) ou a ANS (Agência Nacional de Saúde).

Observações:

- 1) O sistema não permite que os ativos vinculados não podem estar na situação de inadimplência.
- 2) O sistema permite que os ativos de distribuição pública podem ser vinculados em reserva técnica se o titular da conta de reserva técnica possuir Custodiante autorizado indicado.
- 3) O sistema não permite a vinculação em reserva técnica de COE com as seguintes características:
 - a) Campo “Período de Pagamento” preenchido com “ATO”;
 - b) Campo “Barreira de chamada (%)” preenchido na agenda de eventos.

Tela Vinculação em Reserva Técnica

Vinculação em Reserva Técnica			
Instrumento Financeiro			
Tipo IF	Código IF		
COE	TH0115E6ZGS		
Parte		Contraparte	
Código Detentor	Meu Número	Código Reserva Técnica	
54545 00 9	77	54545 97 5	
Dados da Operação			
Quantidade			
3			
Enviar		Limpar Campos	
Desistir			

Descrição dos Campos da Tela Antecipação de Desvinculação em Reserva Técnica

Campo	Descrição
Instrumento Financeiro – Campos de preenchimento obrigatório.	
Tipo	Preenchimento automático.

Campo	Descrição
Código	Código do COE.
Parte (Detentor) e Contraparte (Reserva Técnica) – Campos de preenchimento obrigatório.	
Código Detentor	Código Cetip do Detentor (Conta Própria) do ativo que será incluído em reserva técnica.
Meu Número	Número de controle do participante.
Código Reserva Técnica	Código Cetip de Reserva Técnica (Conta 97) do Participante, Contraparte na operação.
Dados da Operação – Campos de preenchimento obrigatório.	
Quantidade	Quantidade do instrumento financeiro a ser transferido para Conta de Reserva Técnica.

Após preencher os campos e clicar no botão Enviar, o módulo apresenta tela onde o Participante deve verificar os dados da operação, podendo confirmá-los, corrigi-los ou desistir do lançamento.

Vinculação em Reserva Técnica			
Instrumento Financeiro			
Tipo IF COE	Nome do Tipo IF	Certificado de Operações Estruturadas	Código IF TH0115E6ZGS
Registrador 05000.40-7		RIOBM	
Data Emissão 25/05/2015		SEGUNDA-FEIRA	
Data Vencimento 20/03/2018		TERCA-FEIRA	
Dados da operação de Vinculação de Reserva Técnica			
Código Detentor 54545.00-9		BRANCOSEG	Meu Número 77
Código Reserva Técnica 54545.97-5		BRANCOSEG	
Orgão Regulador 27909.00-5		SUSEP	
Quantidade 3			
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>			

Se registro for confirmado é apresentada mensagem com o número do lançamento efetuado.

Lançamento 2016011813651740 efetuado

Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica

Visão Geral

Esta função possibilita a antecipação, parcial ou total, da quantidade do COE em custódia na Conta de Reserva Técnica (Conta 97) do Participante, efetuando a antecipação da desvinculação para a Conta Própria do mesmo.

A operação é comandada exclusivamente pelo participante, se o tipo de movimentação estiver definido como **livre movimentação**. Para o tipo **sem livre movimentação**, é obrigatória a confirmação da SUSEP ou da ANS, no **Módulo de Operações**, função **Manutenção de Operações Pendentes**, para que a operação seja realizada.

A SUSEP ou a ANS definem o tipo de movimentação para cada Participante, em função exclusiva, através do Módulo de Administração do Participante, função Manutenção do Tipo de Desvinculação.

Os dados finais indicados no lançamento são da desvinculação. A data e o nº de controle são gerados na vinculação em reserva técnica e podem ser consultados na função Manutenção de Operações Futuras do Módulo Operações.

Observações:

- 1) É possível efetuar a desvinculação de ativos com situação de inadimplência.
- 2) Esta operação pode ser comandada pelo módulo de Operações, função Manutenção de Operações Futuras onde, depois de selecionada a ação Antecipar para o instrumento financeiro desejado, os dados são apresentados em tela, havendo a necessidade apenas de informar o número da operação que está sendo realizada.
- 3) É possível efetuar a desvinculação no mesmo dia de registro da vinculação em reserva técnica.
- 4) Se até D-1 dias úteis da data do evento, na hipótese do Participante não Efetuar o Lançamento de Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica, a operação de antecipação é gerada automaticamente pelo Módulo com o status **FINALIZADA**.

Tela Antecipação de Desvinculação em Reserva Técnica

Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica				
Instrumento Financeiro				
Tipo IF	Código IF			
COE	TH0115K7DB1			
Parte			Contraparte	
Papel	Código	Meu Número		Código
DETENTOR	54545	70	0	7
				54545 97 5
Dados da Operação				
Quantidade				
1				
Dados Complementares				
Data op. original			Num. Cetip Op. Original	
24 / 11 / 2015			2015112412660190	
<input type="button" value="Enviar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Descrição dos Campos da Tela Antecipação de Desvinculação em Reserva Técnica

Campo	Descrição
Instrumento Financeiro – Campos de preenchimento obrigatório.	
Tipo	Preenchimento automático.
Código	Código do COE.
Parte e Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório.	
Papel	Caixa de seleção com as opções: Detentor e Reserva Técnica.
Código	Código Cetip do Detentor (Conta Própria) ou de Reserva Técnica (Conta 97) do Participante.
Meu Número	Número de controle do participante.
Código	Código Cetip do Detentor (Conta Própria) ou de Reserva Técnica (Conta 97) do Participante, Contraparte na operação.
Dados da Operação – Campos de preenchimento obrigatório.	
Quantidade	Quantidade do COE a ser desvinculado da Conta de Reserva Técnica para a Conta Própria do Participante.
Dados Complementares – Campos de preenchimento obrigatório.	

Campo	Descrição
Data op. original	Data da operação de Vinculação em Reserva Técnica. Pode ser consultada no módulo de Operações item Consultas, função Consulta Operações Futuras, em Data da Inclusão ou no item Lançamento, função Manutenção de Operações Futuras, em Data op. Original.
Número Cetip	Nº de controle dado automaticamente quando efetuada a vinculação em Reserva Técnica. Pode ser consultado no módulo de Operações, item Consultas, função Consulta Operações Futuras, em Num Ctrl Operação ou no item Lançamento, função Manutenção de Operações Futuras, em Número Cetip.

Após preencher os campos e clicar no botão Enviar, o módulo apresenta tela onde o Participante deve verificar os dados da operação, podendo confirmá-los, corrigi-los ou desistir do lançamento.

Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica				
Instrumento Financeiro				
Tipo IF	COE	Nome do Tipo IF	Certificado de Operações Estruturadas	Código IF
Registrador	05000.40-7		RIOBM	TH0115K7DB1
Data Emissão	12/11/2015		QUINTA-FEIRA	
Data Vencimento	20/11/2017		SEGUNDA-FEIRA	
Dados da Operação de Antecipação				
Papel	DETENTOR	Código	54545.70-0	Nome Simplificado
	RESERVA TECNICA	Código	54545.97-5	BRANCOSEG
Orgão Regulador	27909.00-5		SUSEP	Meu Número
Quantidade	1			7
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Corrigir"/> <input type="button" value="Desistir"/>				

Se registro for confirmado é apresentada mensagem com o número do lançamento efetuado.

Lançamento 2016011813651777 efetuado

Consultas

Consulta de Marcação a Mercado

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta de Marcação a Mercado

Visão Geral

Esta consulta disponibiliza a marcação a mercado do COE em uma data ou um período específico.

Tela Consulta Marcação a Mercado COE

Consulta Marcação A Mercado COE

Período MTM de / /
 Período MTM até / /
 Código do COE
 Nome Figura
 Conta Emissor - -
 Nome simplificado Emissor

Para que a consulta seja feita não é necessário o preenchimento dos campos. Após confirmar, o sistema envia a seguinte consulta se o Código do COE for preenchido.

Consulta de Marcação A Mercado COE

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 2 de 2)
 Data e Hora da Consulta: 24/10/2013 - 18:12:22

 **Critério de pesquisa**

Código do COE	Nome Fantasia	Conta Emissor	Nome simplificado Emissor	Valor de MtM	Data de Atualização do MTM	Data de Referência
TH3013H008J	Collar Internacional	05000.40-7	RIOBM	997,14000000	06/08/2013 11:16:01	07/08/2013
TH3013H008J	Collar Internacional	05000.40-7	RIOBM	1.000,37000000	06/08/2013 11:16:53	08/09/2013

Na coluna **Código IF** são exibidos *link* de acesso às características do COE.

Consulta COE

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta COE

Visão Geral

Esta consulta apresenta os COEs registrados na B3.

Tela Filtro Consulta COE

Filtro Consulta COE

Tipo de COE

Código IF

Tipo de Regime

Conta Emissora

Conta Detentora

Classe do Ativo Subjacente

Data de Emissão De

Data de Emissão Até

Data de Vencimento De

Data de Vencimento Até

Data de Registro De

Data de Registro Até

Para que a consulta seja feita e necessário o preenchimento de pelo menos um dos filtros. Após confirmar, o sistema envia a seguinte consulta.

Relação Consulta COE

Página 1 de 4 (Linhas 1 a 25 de 79)
Data e Hora da Consulta: 18/03/2016 - 11:39:27

 Critério de pesquisa

Conta Emissora	Nome Simplificado do Emissor	Classe do Ativo Subjacente	Data de Emissão	Código IF	Nome Fantasia	Data de Vencimento	Quantidade Emitida	Valor Unitário de Emissão
05000.40-7	RIOBM	ACOES	20/03/2015	TH0115C6YF0	TESTE OFERTA PUBLICA	20/03/2018	10	10.000,00000000
05000.40-7	RIOBM	ACOES	26/03/2015	TH0115C6YGB	TESTE ALTERACAO FLUXO	26/03/2020	10	10.000,00000000

(continua)

Valor Financeiro de Emissão	Capital Garantido (%)	Ativo Subjacente	Valor final ativo subjacente	Valor PU	Posição do emissor no derivativo	Quantidade Depositada	Quantidade resgatada/ antecipada	Nome Figura	Data de Registro
100.000,00	100,0000	BVMF3	5,00000000		Comprado	8	1	COE001001 - Call	20/03/2015
100.000,00	200,0000	PETR3	0,00000000		Comprado	8	2	COE001001 - Call	26/03/2015

(continua)

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Fator Path Dependent	Código Identificador	Quantidade de Eventos	Situação	Lookback	Critério de Lookback	Data Inicial de Lookback	Data Final de Lookback	Motivo Simplificação	Data de Simplificação	Instrução CVM 569	Tipo de Regime
		4	CONFIRMADO							Sim	REGISTRADO
			CONFIRMADO							Sim	REGISTRADO
	210310998		CONFIRMADO							Sim	REGISTRADO
	108.23		CONFIRMADO							Não	REGISTRADO

(fim)

Na coluna **Código IF** são exibidos “*link*” de acesso às características do COE. Se acionado, mostra a tela exemplo abaixo.

COE – Certificado de Operações Estruturadas

Manutenção Certificado de Operações Estruturadas			
Instrumento Financeiro			
Código IF	TH0120H7Z55	Conta Emissora	05000.40-7
Tipo de COE	COE001001 - Call	Classe do Ativo Subjacente	ACOES
Nome Fantasia	teste FluxCai	Ativo Subjacente	BBDC4
Data de Emissão	26/08/2020	Data de Vencimento	26/08/2021
Prazo de Emissão	365	Quantidade Emitida	1.000
Valor Unitário de Emissão	1.000,00000000	Valor Financeiro de Emissão	1.000.000,00
Capital Garantido (%)	100,0000	Valor Inicial do Ativo Subjacente	21,00000000
Data Emissão a termo		Código ISIN	
Modalidade	CAPITAL INVESTIDO GARANTIDO	Base Aplicação (%)	100,0000
Instrução CVM 569	Não	Conta Escriturador	
Proteção Contra Proventos	NAO	Posição do emissor no derivativo	Vendido
Tipo de Regime	REGISTRADO	Remunerador no Vencimento	SEM REMUNERACAO
Descrição remunerador		Remunerador Flutuante (%)	
Spread/Cupom (%)		Base	
Cotação Inicial Remunerador		Data Inicial Remunerador	
Data Final Remunerador		Resgate antecipado	Não tem condição
Condição Específica de Resgate		Código Identificador	
Varição quanto			
Valor PU		Data da Última Atualização PU	26/08/2020
Situação do Ativo	CONFIRMADO	Situação do Derivativo	CONFIRMADO
Data de Registro	26/08/2020	Data Disparo de Trigger IN Alta	
Valor Disparo de Trigger IN Alta		Data Disparo de Trigger IN Baixa	
Valor Disparo de Trigger IN Baixa		Data Disparo de Trigger OUT Alta	
Valor Disparo de Trigger OUT Alta		Data Disparo de Trigger OUT Baixa	
Valor Disparo de Trigger OUT Baixa		Valor final ativo subjacente	21,00000000
Fator Path Dependent		Quantidade Depositada	1.000
Quantidade resgatada/ antecipada	0	Entrega Física	
Descrição Entrega Física		Pagamento Extraordinário	
Funcionalidade		Fluxo de Caixa	Sim
Lookback		Critério de Lookback	
Data Inicial de Lookback		Data Final de Lookback	
Detentores			
Nome Simplificado do Detentor	RIOBM	Conta Detentora	05000.10-8
Dados específicos - teste FluxCai			
Strike 1(%)		Quantidade 1	100,00000000
Participação cenário de alta (%)		Período de captura do ativo subjacente para liquidação	100,0000 DATA ÚNICA
Data inicial para fixing		Data para fixing	
Data final para fixing		Tipo de Cotação para Liquidação	25/08/2021 FECHAMENTO
Tipo de Fixing para Vencimento		Tipo de Fixing para Vencimento	SELECIONE
Fluxo de Caixa COE			
Condicionante de Barreira Cupom (%)	Remunerador no Fluxo SEM REMUNERACAO	Base	Condicionante de Barreira Chamada (%)
Memória de Cupom			
Data do Evento	Remunerador (%)	Spread/Cupom (%)	Barreira Cupom (%)
04/05/2021			Barreira Cupom 2 (%)
			Barreira Chamada (%)
			Barreira Chamada 2 (%)
			Fixing
			Fixing 2
Data do Evento	Remunerador (%)	Spread/Cupom (%)	Barreira Cupom (%)
26/08/2021			Barreira Cupom 2 (%)
			Barreira Chamada (%)
			Barreira Chamada 2 (%)
			Fixing
			Fixing 2

[Voltar](#) [Sair](#)

(continua)

Valor PU	Data da Última Atualização PU 05/07/2017
Situação do Ativo CONFIRMADO	Situação do Derivativo CONFIRMADO
Data de Registro 06/07/2017	Data Disparo de Trigger IN Alta
Valor Disparo de Trigger IN Alta	Data Disparo de Trigger IN Baixa
Valor Disparo de Trigger IN Baixa	Data Disparo de Trigger OUT Alta
Valor Disparo de Trigger OUT Alta	Data Disparo de Trigger OUT Baixa
Valor Disparo de Trigger OUT Baixa	Valor final ativo subjacente 30,00000000
Fator Path Dependent	Quantidade Depositada 100
Quantidade resgatada/ antecipada 0	Entrega Física
Descrição Entrega Física	Pagamento Extraordinário
Fluxo de Caixa Sim	Lookback
Critério de Lookback	Data Inicial de Lookback
Data Final de Lookback	
Detentores	
Nome Simplificado do Detentor RIOBM	Conta Detentora 05000.10-8
Dados específicos - RIO-Invest	
Strike 1(%)	100,00000000
Quantidade 1	100,00000000
Participação cenário de alta (%)	100,0000
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	DATA UNICA
Data inicial para fixing	
Data final para fixing	
Data para fixing	05/07/2018
Tipo de Cotação para Liquidação	FECHAMENTO
<input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Sair"/>	

(fim)

Consulta de Ativo Subjacente

Menu Core Derivativos > Consulta > Consulta de Ativo Subjacente

Visão Geral

Esta consulta é sobre os ativos subjacentes que podem ser utilizados nos registros do COE.

Tela Filtro Consulta de Ativo Subjacente

Filtro Consulta de Ativo Subjacente

Código do Ativo Subjacente

Classe do Ativo Subjacente

Caso na tela filtro seja preenchido o Código do Derivativo a consulta trará apenas dados deste ativo, conforme tela abaixo.

Relação Consulta de Ativo Subjacente COE

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 4 de 4)
Data e Hora da Consulta: 24/10/2013 - 18:35:47

 **Critério de pesquisa**

Classe	Código do Ativo Subjacente	Bolsa de Negociação	Índice Valorização	Mês Vencimento	Ano Vencimento	Tipo	Unidade de Negociação	Moeda	Data Limite	Calculado
AÇÕES	BBDC4	REUTERS	BBDC4 Máximo			OUTROS		REAL		Não
AÇÕES	BBDC4	REUTERS	BBDC4M			OUTROS		REAL		Não
AÇÕES	BBDC4	REUTERS	BBDC4			OUTROS		REAL		Não
AÇÕES	BBDC4	REUTERS	BBDC4 Mínimo			OUTROS		REAL		Não

Caso na tela filtro for escolhida apenas a Classe do Ativo Subjacente a consulta apresentará todos os representantes desta classe.

Consulta de Notional Máximo e Mínimo (“Análise de Sensibilidade”)

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta de Notional Máximo e Mínimo

Visão Geral

Essa consulta permite ao participante consultar os valores de Notional Máximo e Mínimo indicados nos COEs nos quais ele é emissor.

Tela Filtro Informação Notional

Consulta Informação Notional

Período Informação Notional de / /

Período Informação Notional até / /

Tipo de COE

Código IF

Conta Emissora - -

Nome Simplificado do Emissor

Para que a consulta seja feita e necessário o preenchimento de pelo menos um campo. Após confirmar, o sistema envia a seguinte consulta conforme tela acima.

Consulta COE - Valor Notional Máximo e Mínimo

Página 1 de 3 (Linhas 1 a 25 de 58)
Data e Hora da Consulta: 22/06/2015 - 17:03:05

 **Critério de pesquisa**

Conta Emissora	Nome Simplificado do Emissor	Código IF	Tipo de COE	Data Refer. Atualização	Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 1	Valor Notional Máximo (%) - Cenário 1	Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 2	Valor Notional Máximo (%) - Cenário 2	Fator de Risco
73410.40-7	ITAUBM	IT0114A2SM0	COE001001 - Call	03/02/2014	0,9906002600	0,9995771000	0,9883388800	1,0019114300	Spot_BRL/USD
73410.40-7	ITAUBM	IT0114A2SM1	COE001001 - Call	03/02/2014	0,9806222000	0,9440072400	1,0378761600	0,8912881700	IPCA_LIMPO

<< < 1 > >> Exibir página > >>

Obter no formato: >

Na coluna **Código IF** são exibidos *link* de acesso às características do COE.

Consulta de Agenda Fluxo de Caixa COE

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta de Agenda Fluxo de Caixa COE

Visão Geral

Essa consulta permite ao emissor e ao detentor consultar os fluxos dos COEs. Essa consulta está disponível para o detentor do COE após a confirmação da operação de depósito.

Importante: A visualização dos dados pelo Detentor antes da confirmação da operação de depósito está disponível no detalhamento da confirmação da operação, através do menu de Manutenção de Operações Pendentes.

Tela Filtro de Fluxo de Caixa COE

Filtro de Fluxo de Caixa COE

Conta Emissora

Código do COE

Após preenchimento dos campos, clicar no botão **Confirmar** e o sistema apresenta tela abaixo:

Relação Fluxo de Caixa COE											
Página 1 de 1 (Linhas 1 a 1 de 1)											
Data e Hora da Consulta: 26/06/2015 - 16:10:24											
 Critério de pesquisa											
Nome Simplificado do Emissor	Conta Emissora	Código do COE	Condicionante de Barreira Cupom (%)	Condicionante de Barreira Chamada (%)	Data do Evento	Remunerador (%)	Spread/Cupom (%)	Barreira Cupom (%)	Barreira Chamada (%)	Fixing	Status
LEMEBM	10020.40-3	LE0115F74VT			28/07/2015	100,0000				24/07/2015	ATIVO

<< < 1 > >>

Obter no formato:

Na coluna **Data do Evento** são exibidos *“link”* de acesso a uma tela com detalhamento do fluxo do COE. Se acionado, mostra a tela exemplo abaixo:

Consulta do Fluxo de Caixa									
Dados do Ativo									
Conta Emissora			Nome Simplificado do Emissor						
05000.40-7			RIOBM						
Código do COE			Quantidade de Eventos						
TH0120H7Z55			2						
Fluxo de Caixa COE									
Condicionante de Barreira Cupom (%)				Remunerador no Fluxo			Base		
				SEM REMUNERACAO					
Condicionante de Barreira Chamada (%)				Memória de Cupom					
Data do Evento	Remunerador (%)	Spread/Cupom (%)	Barreira Cupom (%)	Barreira Cupom 2 (%)	Barreira Chamada (%)	Barreira Chamada 2 (%)	Fixing	Fixing 2	Tipo de Fixing
04/05/2021									
Data do Evento	Remunerador (%)	Spread/Cupom (%)	Barreira Cupom (%)	Barreira Cupom 2 (%)	Barreira Chamada (%)	Barreira Chamada 2 (%)	Fixing	Fixing 2	Tipo de Fixing
26/08/2021									
<input type="button" value="Voltar"/> <input type="button" value="Sair"/>									
Versão para Impressão									

Pendências de Marcação a Mercado e Sensibilidade

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Pendências de Marcação a Mercado e Sensibilidade

Visão Geral

Essa consulta possibilita ao emissor obter informações dos COEs que não possuem MTM e sensibilidade atualizados no último mês. .

Tela Filtro Marcação a Mercado e Sensibilidade

Filtro Marcação a Mercado e Sensibilidade

Código do COE

Nome Figura

Nome Simplificado Emissor

Conta Emissor

Tipo de Consulta

Para que a consulta seja feita é necessário o preenchimento de pelo menos um campo. Após confirmar, o sistema envia a seguinte consulta conforme tela abaixo.

Tela Relação Marcação a Mercado

Relação Marcação a Mercado						
Página 1 de 170 (Linhas 1 a 25 de 4245)						
Data e Hora da Consulta: 22/06/2015 - 16:46:50						
 Critério de pesquisa						
Código do COE	Nome Simplificado Emissor	Conta Emissor	Nome Figura	Valor MTM	Data de atualização do MTM	Data de Referência
MO3314D55A8	MOOCABM	00684.40-2	COE001033 - Participation Forward Limitadores	-1.000,00000000	29/04/2014	29/04/2014
MO3414D411Z	MOOCABM	00684.40-2	COE001034 - Participation Forward Flex II	1.000,00000000	29/04/2014	29/04/2014
TL0114D5BG0	TELBM	66661.40-7	COE001001 - Call	1.111,11000000	02/05/2014	30/04/2014

<< 1 >>

Obter no formato:

Tela Relação Sensibilidade

Relação Sensibilidade									
Página 1 de 102 (Linhas 1 a 25 de 2538)									
Data e Hora da Consulta: 22/06/2015 - 16:55:05									
 Critério de pesquisa									
Código do COE	Nome Simplificado Emissor	Conta Emissor	Nome Figura	Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 1	Valor Notional Máximo (%) - Cenário 1	Valor Notional Mínimo (%) - Cenário 2	Valor Notional Máximo (%) - Cenário 2	Data de Atualização da Sensibilidade	Data Refer. Atualização
IT3214B44FZ	ITAUBM	73410.40-7	COE001032 - Participation Forward Flex	98,97700000	99,91290000	96,53520000	100,25670000	17/03/2014	28/02/2014
CM3414D4S3Z	COPABM	77785.40-6	COE001034 - Participation Forward Flex II	10,00000000	90,00000000	11,00000000	89,00000000	23/04/2014	23/04/2014
CM0114D510J	COPABM	77785.40-6	COE001001 - Call	1,11111000	99,99999000	2,22222000	98,88888000	24/04/2014	20/04/2014

<< 1 >>

Obter no formato:

Consulta Cesta

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta Cesta

Visão Geral

Essa função possibilita ao emissor e ao detentor consultar o detalhamento da Cesta registrada no COE. Essa consulta está disponível para o detentor do COE após a confirmação da operação de depósito.

Importante: A visualização dos dados pelo Detentor antes da confirmação da operação de depósito está disponível no detalhamento da confirmação da operação, através do menu de Manutenção de Operações Pendentes.

Tela Filtro Consulta Cesta

Consulta Cesta	
Nome Simplificado do Participante	<input type="text" value="RIOBM"/>
Conta Emissora	<input type="text"/> - <input type="text"/> - <input type="text"/>
Código IF	<input type="text"/>
Tipo de COE	SELECIONE ▼
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Para que a consulta seja feita não será necessário o preenchimento dos campos. Após confirmar, o sistema envia a seguinte consulta conforme tela abaixo.

Relação de Cestas						
Página 1 de 3 (Linhas 1 a 25 de 60)						
Data e Hora da Consulta: 25/06/2015 - 11:39:53						
 Critério de pesquisa						
Nome Simplificado do Participante	Conta Emissora	Código IF	Tipo de COE	Tipo de Cesta	Moeda paridade	Valor inicial paridade
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZLH	1	BEST OF	REAL	
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZLT	1	STANDARD	REAL	
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZLT	1	STANDARD	REAL	
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZMJ	1	WORST OF	DOLAR DOS EUA	2,00000000
<< < 1 Exibir página >> >> <input type="button" value="Atualizar"/> <input type="button" value="Voltar"/>						
Obter no formato: <input type="button" value="Excel"/>						

(continua)

Data Fixing Paridade	Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
	USD	Fechamento	4,00000000	08/06/2015	
	IBOVESPA	Fechamento	11,00000000	29/07/2015	48,0000
	PETR4	Fechamento	12,00000000	29/07/2015	52,0000
25/06/2015	USD	Fechamento	4,00000000	10/06/2015	

Consulta de Operações de Atualização de PU

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta Cesta

Visão Geral

Essa função possibilita ao emissor consultar os lançamentos de atualização de PU que foram registrados para os participantes que estão sob sua família de digitação.

Tela Filtro Consulta Cesta

Consulta Cesta	
Nome Simplificado do Participante	<input type="text" value="RIOBM"/>
Conta Emissora	<input type="text" value=""/> <input type="text" value=""/> <input type="text" value=""/>
Código IF	<input type="text" value=""/>
Tipo de COE	SELECIONE ▼
<input type="button" value="Confirmar"/> <input type="button" value="Limpar Campos"/> <input type="button" value="Desistir"/>	

Para que a consulta seja feita não será necessário o preenchimento dos campos. Após confirmar, o sistema envia a seguinte consulta conforme tela abaixo.

Relação de Cestas						
Página 1 de 3 (Linhas 1 a 25 de 60)						
Data e Hora da Consulta: 25/06/2015 - 11:39:53						
 Critério de pesquisa						
Nome Simplificado do Participante	Conta Emissora	Código IF	Tipo de COE	Tipo de Cesta	Moeda paridade	Valor inicial paridade
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZLH	1	BEST OF	REAL	
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZLT	1	STANDARD	REAL	
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZLT	1	STANDARD	REAL	
RIOBM	05000.40-7	TH0115F6ZMJ	1	WORST OF	DOLAR DOS EUA	2,00000000
<< < 1 <input type="text"/> Exibir página >> >> <input type="button" value="Atualizar"/> <input type="button" value="Voltar"/>						
Obter no formato: <input type="text" value="Excel"/> ▼						

(continua)

Data Fixing Paridade	Código do Ativo Subjacente	Tipo Cotação para Liquidação	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Data Fixing	Peso %
	USD	Fechamento	4,00000000	08/06/2015	
	IBOVESPA	Fechamento	11,00000000	29/07/2015	48,0000
	PETR4	Fechamento	12,00000000	29/07/2015	52,0000
25/06/2015	USD	Fechamento	4,00000000	10/06/2015	

(fim)

Consulta de “Mais Datas” para Fixing

Menu Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta Mais Datas para Fixing

Visão Geral

Essa função possibilita ao emissor e ao detentor do COE consultar as datas registradas para formação do fixing de vencimento do COE, caso seja indicado “**MAIS DATAS**” no campo variável das figuras “Período de captura do ativo subjacente para liquidação”

Essa consulta está disponível para o detentor do COE após a confirmação da operação de depósito.

Importante: A visualização dos dados pelo Detentor antes da confirmação da operação de depósito está disponível no detalhamento da confirmação da operação, através do menu de Manutenção de Operações Pendentes.

Tela Filtro Consulta Mais Datas para Fixing

> Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta de Mais Datas para Fixing

Filtro Consulta Mais Datas para Fixing

Conta Emissora

Código IF

Para que a consulta seja feita será necessário o preenchimento dos campos. Após confirmar, o sistema envia a seguinte consulta conforme tela abaixo.

> Certificado de Operações Estruturadas > Consulta > Consulta de Mais Datas para Fixing

HOMOLOGAÇÃO

Mais Datas para Fixing

Página 1 de 1 (Linhas 1 a 3 de 3)

Data e Hora da Consulta: 27/08/2020 - 16:25:55



Conta Emissora	Código IF	Tipo de Fixing para Vencimento	Data Fixing
05000.40-7	TH0120H7Z5H	Média do período	24/08/2021
05000.40-7	TH0120H7Z5H	Média do período	25/08/2021
05000.40-7	TH0120H7Z5H	Média do período	26/08/2021

Atualizar

Voltar

<< < 1 Exibir página >>>

Atualizar

Voltar

Obter no formato:

Excel

(fim)

Informações Adicionais

Ativos x Naturezas Econômicas

Emissor/Registrador

COE: BANCO COMERCIAL, BANCO DE INVESTIMENTO, BANCO MULTIPLO 01 AO 22, CAIXA ECONOMICA E BNDES

Escriturador

COE: AGENCIA DE FOMENTO; BANCO COMERCIAL; BANCO DE CAMBIO; BANCO DE DESENVOLVIMENTO; BANCO DE INVESTIMENTO; BANCO MULTIPLO 01 AO 22; CAIXA ECONOMICA; COMPANHIA HIPOTECARIA; COOPERATIVA DE CREDITO; COOPERATIVA DE CREDITO RURAL; COOPERATIVA DE ECONOMIA E CREDITO MUTUO; COOPERATIVA DE PRODUTORES RURAIS; SOCIEDADE CORRETORA DE CAMBIO; SOCIEDADE CORRETORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS; SOCIEDADE DE CREDITO, FINANCIAMENTO E INVESTIMENTO; SOCIEDADE DE CREDITO IMOBILIARIO; SOCIEDADE DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS.

Operação de Intermediação no Mercado Primário para COE

Participante Intermediador sem esforços restritos:

BANCO MÚLTIPLO, CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, BANCO COMERCIAL, BANCO DE INVESTIMENTO, SOCIEDADE CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS, SOCIEDADE DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS OU CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Participante Intermediador com esforços restritos:

BANCO MÚLTIPLO, CAIXA ECONÔMICA FEDERAL, BANCO COMERCIAL, BANCO DE INVESTIMENTO, SOCIEDADE CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS, SOCIEDADE DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS OU CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Participante emissor:

TODOS OS EMISSORES AUTORIZADOS POR LEGISLAÇÃO HABILITADOS NO SISTEMA

Participante comprador final:

TODOS OS PARTICIPANTES AUTORIZADOS POR LEGISLAÇÃO A MANTER TAIS ATIVOS EM POSIÇÃO HABILITADOS NO SISTEMA.

Operação de Intermediação no Mercado Secundário para COE

Participante Intermediador:

COE: BANCO MULTIPLO COM CARTEIRA COMERCIAL E/OU DE INVESTIMENTO; BANCO COMERCIAL; BANCO DE INVESTIMENTO; SOCIEDADE CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS; SOCIEDADE DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS

Anexo – Descrição dos campos das figuras

Descrição dos campos Específicos de cada COE

Campo	Descrição
Dados Específicos – COE001001 - Call	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001002 - Put	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001003 - Call KO	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p>
Rebate no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Pagamento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Ato e Vencimento.</p> <p>Se indicado "Ato" e houver disparo do trigger, o pagamento do COE será antecipado à data do disparo. Se indicado "Vencimento" e houver disparo do trigger, o contrato será marcado sendo o pagamento efetuado apenas no vencimento.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia.</p> <p>Se indicado "Europeia" apenas a "Data para Fixing" pode ser preenchido. Se indicado "Americana" apenas a "Data Inicial para Verificação" e "Data Final para Verificação" podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo") e menor que "Data Final para Verificação"</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”.</p> <p>Essa data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001004 - Put KO	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>

Campo	Descrição
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p>
Rebate no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Pagamento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Ato e Vencimento. Se indicado "Ato" e houver disparo do trigger, o pagamento do COE será antecipado 'a data do disparo.</p> <p>Se indicado "Vencimento" e houver disparo do trigger, o contrato será marcado sendo o pagamento efetuado apenas no vencimento.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia.</p> <p>Se indicado "Europeia" apenas a "Data para Fixing" pode ser preenchido. Se indicado "Americana" apenas a "Data Inicial para Verificação" e "Data Final para Verificação" podem ser preenchidos.</p>

Campo	Descrição
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”.</p> <p>Essa data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001005 - Call Spread

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001006 - Put Spread	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Limitador Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior ou igual a 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Campo com as opções:</p> <p>Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001007 - Straddle (utilizado como exemplo da tela)	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for selecionado "Janela de Datas" ou "Mais Datas" .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001008 - Straddle Call KO

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado 'Não', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001009 - Straddle Put KO	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for menor ou igual a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado ‘Não’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001010 - Straddle KO Call_Put	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Barreira no cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p>
Rebate no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p>
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado ‘Não’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>

Campo	Descrição
Rebate no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Tipo de Cotação para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Período de Verificação de Barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado "Europeia" apenas a "Data para Fixing" pode ser preenchido. Se indicado "Americana" apenas a "Data Inicial para Verificação" e "Data Final para Verificação" podem ser preenchidos.
Data Inicial para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana". A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo") e menor que "Data Final para Verificação" Formato: DD/MM/AAAA.
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana". Essa data deve ser posterior a indicada no campo "Data Inicial para Verificação", sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil. Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001011 Digital Call e COE001012 - Digital Put	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Remuneração Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado.</p> <p>Campo com as opções: Pré, DI, PRE252-LIN e NO PERIODO.</p>
Remunerador Flutuante Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001013 - Double Digital

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Tipo de Cotação para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré, DI, PRE252-LIN e NO PERIODO.
Remuneração dentro (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação estiver entre o Strike 1 e o Strike 2. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais.
Remuneração fora (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação estiver abaixo do Strike 1 ou acima do Strike 2. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais.
Remuneração Flutuante dentro (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual destacado a ser aplicado sobre o Remunerador Flutuante quando detectado que a cotação estiver entre o Strike 1 e o Strike 2. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais.
Remuneração Flutuante fora (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual destacado a ser aplicado sobre o Remunerador Flutuante quando detectado que a cotação estiver abaixo do Strike 1 ou acima do Strike 2. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001014 - Collar	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2</p> <p>Formato: Número com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001015 - Range Accrual	
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Remuneração Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado.</p> <p>Campo com as opções: Pré e DI.</p>

Campo	Descrição
Remunerador Flutuante Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”</p>
Tipo de Cotação para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Tipo de cotação do ativo subjacente capturado em todas as datas entre a “Data Inicial para verificação” e a “Data Final para verificação”.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Barreira Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Barreira no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Dados Específicos – COE001016 - Strangle	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001017 - Strangle Call KO	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado 'Não', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001018 - Strangle Put KO

Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado 'Não', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção "Janela de Datas"</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo "Tipo de Fixing para Vencimento".</p> <p>Caso seja indicado "Mais Datas" as datas serão indicadas na seção "Mais Datas".</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Tipo de Cotação para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Período de Verificação de Barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado "Europeia" apenas a "Data para Fixing" pode ser preenchido. Se indicado "Americana" apenas a "Data Inicial para Verificação" e "Data Final para Verificação" podem ser preenchidos.
Data Inicial para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana". A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo") e menor que "Data Final para Verificação" Formato: DD/MM/AAAA.
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana". Essa data deve ser posterior a indicada no campo "Data Inicial para Verificação", sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil. Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001019 - Strangle KO Call_Put	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>

Campo	Descrição
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado 'Não', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>
Rebate no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção "Janela de Datas"</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo "Tipo de Fixing para Vencimento".</p> <p>Caso seja indicado "Mais Datas" as datas serão indicadas na seção "Mais Datas".</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado "Europeia" apenas a "Data para Fixing" pode ser preenchido. Se indicado "Americana" apenas a "Data Inicial para Verificação" e "Data Final para Verificação" podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana". A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo") e menor que "Data Final para Verificação"</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001020 - Barreiras Móveis	
Barreira no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>

Campo	Descrição
Barreira Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Remuneração Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado.</p> <p>Campo com as opções: Pré e DI.</p>
Remunerador Flutuante Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.</p>
Tipo de Cotação para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Tipo de cotação do ativo subjacente capturado em todas as datas entre a “Data Inicial para verificação” e a “Data Final para verificação”.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Fator barreira móvel superior	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Fator que deve ser somado diariamente da barreira superior.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.</p>
Fator barreira móvel inferior	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Fator que deve ser subtraído diariamente da barreira inferior.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.</p>
Dados Específicos – COE001021 - Call KI	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção "Janela de Datas"</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo "Tipo de Fixing para Vencimento".</p> <p>Caso seja indicado "Mais Datas" as datas serão indicadas na seção "Mais Datas".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Rebate KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira KI	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001022 - Put KI

Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Barreira KI	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Rebate KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”.</p> <p>Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001023 - Call KIKO	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Barreira KI	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Rebate KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira KO	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Indica a barreira de KO da estrutura.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Rebate KO (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for menor que a barreira de KO no período de verificação.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>

Campo	Descrição
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001024 - Put KIKO

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Barreira KI	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Rebate KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira KO	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Indica a barreira de KO da estrutura.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Rebate KO (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for menor que a barreira de KO no período de verificação.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001025 - Double No Touch

Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
---	---

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Barreira superior (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e maior que Barreira inferior.</p>
Barreira inferior (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e menor que Barreira superior.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Remuneração Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado.</p> <p>Campo com as opções: Pré, DI e NO PERÍODO.</p>
Remunerador Flutuante Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Cupom Remunerador Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”</p>
Dados Específicos – COE001026 - One Touch	
Barreira (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Deverá ser preenchido com valor diferente de zero.</p>
Direção barreira	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a forma de rompimento da barreira que será atingida.</p> <p>Campo com as opções: Acima e Abaixo,</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”.</p> <p>Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Remuneração Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado.</p> <p>Campo com as opções: Pré, DI e NO PERÍODO.</p>
Remunerador Flutuante Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Tipo de cotação do ativo subjacente capturado em todas as datas entre a “Data Inicial para verificação” e a “Data Final para verificação”. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Dados Específicos – COE001027 - Condor	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior ou igual a 0 e menor que o “Limitador Cenário de Alta”.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que o "Limitador Cenário de Baixa".</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção "Janela de Datas"</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo "Tipo de Fixing para Vencimento".</p> <p>Caso seja indicado "Mais Datas" as datas serão indicadas na seção "Mais Datas".</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for selecionado "Janela de Datas" ou "Mais Datas" .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001028 - Butterfly

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Quantidade 1	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.
Participação cenário de baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Limitador Cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior ou igual a 0 e menor que o “Limitador Cenário de Alta”.
Participação cenário de alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Limitador Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que o “Limitador Cenário de Baixa”.

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001029 - Straddle Call KO e Put KO com Put Spread KI	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Limitador Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior ou igual a 0 e menor que o “Limitador Cenário de Alta”.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado ‘Não’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out , as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>
Rebate no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Barreira KIKO	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001030 - Put Spread com KI + Call com KO	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Limitador Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior ou igual a 0 e menor que o “Limitador Cenário de Alta”.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.</p>
Opções Dependentes	<p>Campo de preenchimento obrigatório</p> <p>Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas.</p> <p>Caso selecionado ‘Não’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas individualmente, permanecendo a exposição para a opção ainda ativa.</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não.</p>

Campo	Descrição
Rebate no Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Verificação de Barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado "Europeia" apenas a "Data para Fixing" pode ser preenchido. Se indicado "Americana" apenas a "Data Inicial para Verificação" e "Data Final para Verificação" podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana". A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo") e menor que "Data Final para Verificação"</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Americana".</p> <p>Essa data deve ser posterior a indicada no campo "Data Inicial para Verificação", sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001031 - Forward	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
Dados Específicos – COE001032 – Participation Forward Flex	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Vértice de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, menor ou igual ao Strike 1.</p>
Vértice de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual ao Strike 1.</p>
Participação cenário de alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de baixa 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>Máximo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Mínimo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Média no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p>

Dados Específicos – COE001033 – Participation Forward Limitadores

Strike 1(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Limitador cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que o “Limitador Cenário de Baixa”.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior ou igual a 0 e menor que o “Limitador Cenário de Alta”.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001034 – Participation Forward Flex II

Vértice de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, menor ou igual ao Strike 1.</p>
Strike 1(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>

Campo	Descrição
Vértice de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual ao Strike 1.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de baixa 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001035 – VPutDigital + CCallDigital + CallSpread

Strike 1(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>

Campo	Descrição
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que o "Strike 2 (%)".</p>
Remuneração abaixo (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente, caso a cotação desse ativo subjacente termine abaixo do Strike 1. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais.</p>
Remuneração acima (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente, caso a cotação desse ativo subjacente termine acima do Strike 1. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção "Janela de Datas"</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo "Tipo de Fixing para Vencimento".</p> <p>Caso seja indicado "Mais Datas" as datas serão indicadas na seção "Mais Datas".</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001036 - Fence

Strike 1(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e menor que strike 2.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Limitador Cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001037 – Fence KI CallSpread

Campo	Descrição
Strike 1(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Strike 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1.
Participação cenário de alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Participação cenário de baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas. Indica como será formado o fixing no vencimento. Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas” Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”. Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.
Data para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Limitador Cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Barreira KI	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Rebate KI (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. Indicação de qual será a cotação a ser considerada. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Período de Verificação de Barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Americana e Europeia. Se indicado “Europeia” apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana” apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.
Data inicial para verificação	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação” Formato: DD/MM/AAAA.
Data final para verificação	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil. Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001038 – Double One Touch

Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Barreira superior (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e maior que Barreira inferior.</p>
Barreira inferior (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e menor que Barreira superior.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, <i>se indicado “Americana”</i>. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, <i>se indicado “Americana”</i>. Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Remuneração Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado.</p> <p>Campo com as opções: Pré, DI e No Período.</p>
Remunerador Flutuante Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”</p>

Dados Específicos – COE001039 – Call Spread + Put Spread

Para essa figura, no campo fixo Ativo Subjacente, preencher como ATIVOCOE39 e no campo Valor Inicial do Ativo Subjacente, preencher como 10.000.

Classe do ativo subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 1 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).</p>
----------------------------	---

Campo	Descrição
Ativo Subjacente 1	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções para o Ativo Subjacente 1, referente à Classe do Ativo Subjacente 1 (IBOVESPA, DOLAR DOS EUA).
Valor Inicial Ativo Subjacente 1	Campo de preenchimento obrigatório. Valor inicial que serve para o cálculo (os percentuais indicados nos campos incidirão sobre este campo) de limitadores e strikes referentes ao Ativo Subjacente 1.
Strike 1(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1.
Quantidade 1	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a quantidade do Ativo Subjacente 1.
Limitador cenário de alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente 1.
Participação cenário de alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente 1.
Classe do Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 2 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).
Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções para o Ativo Subjacente 2, referente à Classe do Ativo Subjacente 2 (IBOVESPA, DOLAR DOS EUA).
Valor Inicial Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Valor inicial que serve para o cálculo (os percentuais indicados nos campos incidirão sobre este campo) de limitadores e strikes referentes ao Ativo Subjacente 2.
Strike 2(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 2.
Quantidade 2	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a quantidade do Ativo Subjacente 2.
Limitador cenário de baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente 2.

Campo	Descrição
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do Ativo Subjacente 2.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”..</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 1.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Tipo de cotação para liquidação 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 2.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001040 – Put Spread + Put Spread

Para essa figura, no campo fixo Ativo Subjacente, preencher como ATIVOCOE40 e no campo Valor Inicial do Ativo Subjacente, preencher como 10.000.

Classe do Ativo Subjacente 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 1 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).</p>
Ativo Subjacente 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções para o Ativo Subjacente 1, referente à Classe do Ativo Subjacente 1 (IBOVESPA, DOLAR DOS EUA).</p>
Valor Inicial Ativo Subjacente 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor inicial que serve para o cálculo (os percentuais indicados nos campos incidirão sobre este campo) de limitadores e strikes referentes ao Ativo Subjacente 1.</p>

Campo	Descrição
Strike 1(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1.
Quantidade 1	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a quantidade do Ativo Subjacente 1.
Limitador cenário de baixa 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente 1.
Participação cenário de baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente 1.
Classe do Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 2 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).
Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções para o Ativo Subjacente 2, referente à Classe do Ativo Subjacente 2 (IBOVESPA, DOLAR DOS EUA).
Valor Inicial Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Valor inicial que serve para o cálculo (os percentuais indicados nos campos incidirão sobre este campo) de limitadores e strikes referentes ao Ativo Subjacente 2.
Strike 2(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 2.
Quantidade 2	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a quantidade do Ativo Subjacente 2.
Limitador cenário de baixa 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente 2.
Participação cenário de baixa 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do Ativo Subjacente 2.

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 1.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste</p>
Tipo de Cotação para Liquidação 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 2.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados Específicos – COE001041 – Wedding Cake

Quantidade de Camadas	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a quantidade de camadas no contrato.</p> <p>Campo com as opções: 2 ou 3</p>
Strike 1(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, deve ser maior que strike 1 e maior que zero.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>

Campo	Descrição
Strike 3 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se indicado “3” no campo “Quantidade de Camadas”; se indicado “2”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, deve ser maior que strike 2 e maior que zero.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Strike 4 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se indicado “3” no campo “Quantidade de Camadas”; se indicado “2”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, deve ser maior que strike 3 e maior que zero.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Strike 5 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, deve ser maior que strike 4 e maior que zero.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Strike 6 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, deve ser maior que strike 5 e maior que zero.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Remuneração adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado nas camadas.</p> <p>Campo com as opções: Pré, DI, PRE252-LIN e NO PERIODO.</p>
Remunerador flutuante Camada 1 (%)	<p>Indica o percentual do “Remunerador adicional” válido para a camada 1.</p> <p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI” no campo “Remunerador adicional”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Camada 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o cupom a ser pago se a cotação estiver entre o Strike 1 e o Strike 2 ou entre o Strike 5 e o Strike 6.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Remunerador flutuante Camada 2 (%)	<p>Indica o percentual do “Remunerador adicional” válido para a camada 2.</p> <p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI” no campo “Remunerador adicional”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Camada 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o cupom a ser pago se a cotação estiver entre o Strike 2 e o Strike 3 ou entre o Strike 4 e o Strike 5.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Remunerador flutuante Camada 3 (%)	<p>Indica o percentual do “Remunerador adicional” válido para a camada 3.</p> <p>Campo de preenchimento obrigatório se indicado “DI” no campo “Remunerador adicional” e “3” no campo “Quantidade de Camadas”.</p> <p>Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Camada 3 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se indicado “3” no campo “Quantidade de Camadas”; se indicado “2”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Indica o cupom a ser pago se a cotação estiver entre o Strike 3 e o Strike 4.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente se indicado “Europeia” no campo “Período de Verificação de barreiras”, e for utilizada uma data única para fixing.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente se indicado “Europeia” no campo “Período de Verificação de barreiras”, e for utilizada uma janela de datas para formação do fixing.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente se indicado “Europeia” no campo “Período de Verificação de barreiras”, e for utilizada uma janela de datas para formação do fixing.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, sendo que o prazo máximo de dias entre a “Data Final para Fixing” e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Tipo de cotação para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será o tipo de cotação a ser considerada como fixing para a liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de Verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se a verificação das barreiras será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia).</p>
Data Inicial para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório somente se indicado “Americana” no campo “Período de Verificação de barreiras”.</p> <p>Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”</p>

Campo	Descrição
Data final para verificação	Campo de preenchimento obrigatório somente se indicado “Americana” no campo “Período de Verificação de barreiras”. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.

Dados Específicos – Figura COE 001042 – Call KO1 + Call KO2

Informações referentes a Call KO1	
Strike 1(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Observação: Caso as barreiras de alta sejam iguais, os strikes deverão ser diferentes.
Quantidade 1	Campo de preenchimento obrigatório. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.
Participação cenário de Alta 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.
Barreira no cenário de Alta 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Observação: Caso os strikes sejam iguais, as barreiras de alta deverão ser diferentes.
Rebate no Cenário de Alta 1(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de alta seja atingida.
Informações referentes a Call KO2	

Campo	Descrição
Strike 2(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Observação: Caso as barreiras de alta sejam iguais, os strikes deverão ser diferentes.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p>
Participação cenário de Alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p>
Barreira no cenário de Alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Observação: Caso os strikes sejam iguais, as barreiras de alta deverão ser diferentes.</p>
Rebate no Cenário de Alta 2(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de alta seja atingida.</p>
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p>

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Data única”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Janela de Datas”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Janela de Datas”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se a verificação das barreiras será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia).</p>
Data Inicial para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana.</p> <p>Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”</p>

Campo	Descrição
Data final para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana.</p> <p>Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.
<hr/> Dados Específicos – Figura COE 001043 – Edge Accrual <hr/>	
Data inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”</p>

Campo	Descrição
Data final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento..
Tipo de cotação para verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na liquidação da operação.
Barreira (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Esta barreira será considerada para contabilizar os dias em que a performance do ativo respeitou, ou não, o limite estabelecido.
Direção da Barreira	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a forma de rompimento da barreira que será atingida.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré, Pré252-Lin e DI
Cupom Remunerador Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré” ou “Pré252-Lin”. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal será considerada como “+”
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. Para o indicador “Pré” ou “Pré252-Lin”, este campo não deverá ser preenchido.

Dados específicos - Figura COE 001044 – Podium

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Remuneração Adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o tipo de remunerador que será utilizado.</p> <p>Campo com as opções: PRÉ, PRÉ 252, DI, e NO PERIODO.</p>
Remunerador Flutuante Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”.</p> <p>Para os indicadores PRÉ, PRÉ 252 e NO PERIODO, este campo não deverá ser preenchido. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Remunerador Adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré” ou “Pré252-Lin”.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”</p>
Barreira de Baixa (%)	<p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Deverá ser preenchido com valor menor ao que o indicado no campo Strike 1 (%).</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e igual ou inferior a 100.</p>

Campo	Descrição
Cupom barreira de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se preenchido o campo “Barreira de Baixa (%)”.</p> <p>Indica o cupom a ser pago caso todos os ativos da cesta terminem acima da Barreira de Baixa. É aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais. Deve ser diferente de 0.</p>
Quantidade mínima de ativos acima do Strike	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a quantidade mínima exigida de ativos da cesta com valor igual ou acima do Strike no vencimento para que haja pagamento de Remunerador Adicional, Remunerador Flutuante Adicional e Cupom Remunerador Adicional.</p> <p>Formato: Numérico com 2 inteiros, maior ou igual a 1 e inferior à quantidade de ativos da cesta.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” e menor que “Data Final para Fixing”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for selecionado "Janela de Datas" ou "Mais Datas" .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da "Data fixing" (inclusive) até a "Data Fixing 2" (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Observação: Para o registro desta figura deve-se utilizar Cesta de ativos do tipo Período de captura do ativo subjacente para liquidação com, no mínimo, dois ativos.

Dados específicos - Figura COE 001045 – Troca de indexadores

Para essa figura, no campo fixo Ativo Subjacente, preencher como ATIVOCOE45 e no campo Valor Inicial do Ativo Subjacente, preencher como 10.000.

Campo	Descrição
Ativo Subjacente Período 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções para o Ativo Subjacente 1 (Pré, DI ou IPCA).</p>
Participação Indexador 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 1” indicado como “DI” ou “IPCA”.</p> <p>Se “Ativo Subjacente 1” e “Ativo Subjacente 2” forem preenchidos de forma igual, selecionando “DI” ou “IPCA” em ambos, este campo deve ser preenchido com um percentual diferente de “Participação Indexador 2 (%)”.</p> <p>Para “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Cupom Período 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 1” indicado como “Pré”. Preenchimento opcional se indicado como “DI” ou “IPCA”.</p> <p>Se “Ativo Subjacente 2” também tiver sido indicado como “Pré”, este campo deve ser preenchido com um percentual diferente de “Cupom Período 2 (%)”.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.</p>
Base Período 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando informado o campo Cupom Período 1 (%).</p> <p>Campo indicador para informar a base do Cupom do Período 1.</p> <p>Campo com as opções: 252 exp, 360 exp e 360 lin.</p>
Ativo Subjacente Período 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções para o Ativo Subjacente 2 (Pré, ou DI ou IPCA).</p>
Participação Indexador 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 2” indicado como “DI” ou “IPCA”.</p> <p>Se “Ativo Subjacente 1” e “Ativo Subjacente 2” forem preenchidos de forma igual, selecionando “DI” ou “IPCA” em ambos também tiver sido indicado como “DI”, este campo deve ser preenchido com um percentual diferente de “Participação Indexador 1 (%)”.</p> <p>Para “Pré”, este campo não deverá ser preenchido.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Cupom Período 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 2” indicado como “Pré”. Preenchimento opcional se indicado como “DI” ou “IPCA”.</p> <p>Se “Ativo Subjacente 1” também tiver sido indicado como “Pré”, este campo deve ser preenchido com um percentual diferente de “Cupom Período 1 (%)”.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.</p>
Base Período 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório, quando informado o campo Cupom Período 2 (%).</p> <p>Campo indicador para informar a base do Cupom do Período 2.</p> <p>Campo com as opções: 252 exp, 360 exp e 360 lin.</p>
Data da troca do ativo subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a data na qual haverá a troca de ativo subjacente. Esta data deverá ser maior que a data de início e menor que a data de vencimento</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Dados específicos - Figura COE001046 – CallSpread + Call KO	
Strike 1(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Strike do Callspread. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente para o Callspread.</p>

Campo	Descrição
Limitador Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente, utilizado no Callspread. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, deverá ser maior que o Strike 1 (%) e maior que 0.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Strike da Call KO. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Participação cenário de alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente para a Call KO.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira cenário de Alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Barreira de KO. Indica o percentual sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que o Strike 2 (%) e maior que zero.</p>
Rebate no Cenário de Alta 2(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de alta seja atingida.</p>
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo "Data Inicial para Fixing", sendo que o prazo máximo de dias entre a "Data Final para Fixing" e o vencimento é de 5 dias úteis e o prazo mínimo entre estas datas é 1 dia útil.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se a verificação das barreiras será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia).</p>
Data Inicial para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a "data final de verificação."</p>
Data final para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Esta data deve ser superior à indicada no campo "Data Inicial para verificação", e inferior a data de vencimento.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados específicos - Figura COE 001047 – CCall + CCallKO + VPutKO + CPutKI

1 - Dados CCall Vanilla

Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>O Strike indicado deverá ser maior que zero.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de alta 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>O Número indicado deverá ser maior que zero.</p>

2 - Dados CCall KO (Up and Out)

Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>O Strike indicado deverá ser igual ao Strike 1.</p> <p>O Strike indicado deverá ser maior que zero.</p>
--------------	---

Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p>
--------------	--

Participação cenário de Alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>O Número indicado deverá ser maior que zero.</p>
------------------------------------	---

Campo	Descrição
Barreira no cenário de Alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>A barreira de KO2 indicada deverá ser igual a barreira de KO3.</p> <p>O Número indicado deverá ser maior que zero.</p>
Rebate no Cenário de Alta 2(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de alta seja atingida.</p>
3 – Dados VPut KO (Up and Out)	
Strike 3 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>O Strike indicado deverá ser menor/igual que os Strikes 1 e 2.</p> <p>O Strike indicado deverá ser maior que zero.</p>
Quantidade 3	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p>
Participação cenário de Baixa 3 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>O Número indicado deverá ser maior que zero.</p>

Campo	Descrição
Barreira no cenário de Alta 3 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. O Número indicado deverá ser maior que zero.
Rebate no Cenário de Alta 3 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de alta seja atingida.
4 – Dados CPut KI (Up and In)	
Strike 4 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. O Strike indicado deverá ser maior que zero.
Quantidade 4	Campo de preenchimento obrigatório. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.
Participação cenário de Baixa 4 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. O Número indicado deverá ser maior que zero.

Campo	Descrição
Barreira KI 4	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura.</p> <p>A barreira de KI não deverá ser menor que o Strike 4.</p>
Rebate KI 4(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE caso a cotação do ativo não atinja a barreira de Knock-in.</p>
Tipo de Cotação para verificação de barreiras cenário de alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se a verificação da barreira será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia).</p> <p>A indicação será válida para todas as barreiras da estrutura (KO1,KO2 e KI).</p>
Data Inicial para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana.</p> <p>Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”</p>

Campo	Descrição
Data final para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana.</p> <p>Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Data única”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Janela de Datas”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Janela de Datas”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados específicos - COE 001048 – Digital Put KO Americano

Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>O Strike indicado deverá ser maior que zero.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Data única”.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Janela de Datas”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” = “Janela de Datas”. Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.
Tipo de Cotação para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na liquidação da operação.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré, DI, PRE252-LIN e NO PERÍODO.
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. Para o indicador “Pré”, “PRE252-LIN” e “NO PERÍODO”, este campo não deverá ser preenchido. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Cupom Remunerador Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”, “PRE252-LIN” e “NO PERÍODO”. Formato: Numérico com 9 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”
Barreira (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Deverá ser preenchido com valor diferente de zero.

Campo	Descrição
Direção barreira	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a forma de rompimento da barreira que será atingida.</p> <p>Campo com as opções: Acima e Abaixo.</p> <p>Se “ACIMA”: a barreira é atingida caso a cotação do ativo seja maior ou igual à barreira.</p> <p>Se “ABAIXO”: a barreira é atingida caso a cotação do ativo seja menor ou igual à barreira.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Essa data deve ser posterior a indicada no campo “Data Inicial para Verificação”, sendo que o prazo mínimo de dias entre as datas deve ser de 1 dia útil.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Tipo de cotação do ativo subjacente em todas as datas entre a “Data Inicial para verificação” e a “Data Final para verificação”.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Rebate KO(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando a cotação do ativo atingir a barreira de <i>knock out</i> durante o período verificação.</p>

Campo	Descrição
Período de Pagamento	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Ato e Vencimento. Se indicado “Ato” e houver disparo da barreira, o pagamento do COE será antecipado na data do disparo. Se indicado "Vencimento" e houver disparo da barreira, o pagamento do rebate será efetuado apenas no vencimento.</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none">• Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.• Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados específicos - COE 001049 – Call KO + Put

Para essa figura, no campo fixo Ativo Subjacente, preencher como ATIVOCOE49 e no campo Valor Inicial do Ativo Subjacente, preencher como 10.000.

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 1 (ativo subjacente da Call KO).</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste</p>

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 2 (ativo subjacente da Put).</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

1- Informações referentes a Call KO

Classe do ativo subjacente 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 1 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).</p>
Ativo Subjacente 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Ativo subjacente da Call KO.</p> <p>Campo com as opções IBOVESA e DOLAR DOS EUA.</p>
Valor Inicial Ativo Subjacente 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Valor inicial do Ativo Subjacente 1. Esse valor serve de referência para o cálculo do strike e da barreira de KO da Call KO.</p> <p>Formato: numérico, 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike da Call KO, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente 1. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Barreira cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a barreira de knock out da Call KO, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente 1.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Rebate KO(%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de knock out seja atingida no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p>
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação da barreira de knock out.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (Europeia).</p> <p>Se indicado “Europeia”, apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana”, apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data inicial da janela de verificação da barreira de knock out. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data final da janela de verificação da barreira de knock out. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

2- Informações referentes a Put

Campo	Descrição
Classe do Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 2 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).
Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Ativo subjacente da Put. Campo com as opções IBOVESPA e DOLAR DOS EUA.
Valor Inicial Ativo Subjacente 2	Campo de preenchimento obrigatório. Valor inicial do Ativo Subjacente 2. Esse valor serve de referência para o cálculo do strike da Put. Formato: numérico, 10 inteiros e 4 decimais.
Strike 2(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar o strike da Put, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 2. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero.
Quantidade 2	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a quantidade do Ativo Subjacente 2. A quantidade indicada deverá ser maior que zero. Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.
Participação cenário de baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente 2. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados específicos - COE 001050 – Call Strike Lookback

Para esta figura, a utilização da funcionalidade de Lookback é obrigatória. Portanto, os campos referentes ao Lookback, no registro das características do Instrumento Financeiro, deverão seguir as instruções de preenchimento indicadas abaixo.

Se houver atualização da cotação inicial do ativo por motivo de Lookback, o emissor deverá fazer esta atualização através da função Atualização de PU> Valores Lookback.

Campos Fixos – Dados do Lookback

Lookback	Nesta figura, este campo é de preenchimento obrigatório. Deverá ser selecionada a opção "Sim"
Critério de Lookback	Nesta figura, este campo é de preenchimento obrigatório. Deverá ser selecionado "Máximo" ou "Mínimo".

Campo	Descrição
Data Inicial de Lookback	<p>Nesta figura, este campo é de preenchimento obrigatório. Como padrão, independentemente de qual seja a primeira data efetiva de verificação de Lookback, este campo deverá ser registrado com a mesma data informada no campo “Data de Emissão” do contrato.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data Final de Lookback	<p>Nesta figura, este campo é de preenchimento obrigatório. Deverá ser registrado com a última data de verificação de Lookback.</p> <p>Nesta data, o sistema criará a pendência “Valores Lookback”, de forma que o emissor terá a opção de atualizar o valor inicial do ativo subjacente, conforme critério adotado. O lançamento deverá ser feito via função de Atualização de PU (Valores Lookback).</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Dados Específicos da figura	
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p> <p>Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 1.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>
Participação cenário de alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Número indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0</p>

Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Data de Observação 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informa a 1ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data de Observação 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informa a 2ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Data de Observação 3	Campo de preenchimento opcional. Informa a 3ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 4	Campo de preenchimento opcional. Informa a 4ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 5	Campo de preenchimento opcional. Informa a 5ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 6	Campo de preenchimento opcional. Informa a 6ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 7	Campo de preenchimento opcional. Informa a 7ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 8	Campo de preenchimento opcional. Informa a 8ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 9	Campo de preenchimento opcional. Informa a 9ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 10	Campo de preenchimento opcional. Informa a 10ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 11	Campo de preenchimento opcional. Informa a 11ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 12	Campo de preenchimento opcional. Informa a 12ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 13	Campo de preenchimento opcional. Informa a 13ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
Data de Observação 14	Campo de preenchimento opcional. Informa a 14ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 15	Campo de preenchimento opcional. Informa a 15ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 16	Campo de preenchimento opcional. Informa a 16ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 17	Campo de preenchimento opcional. Informa a 17ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 18	Campo de preenchimento opcional. Informa a 18ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 19	Campo de preenchimento opcional. Informa a 19ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 20	Campo de preenchimento opcional. Informa a 20ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>Máximo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Mínimo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Média no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p>

Dados específicos – Figura COE 001051 – Call Spread KI + Put

Informações referentes a Call Spread KI + Put

Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade de Call Spread KI. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>

Campo	Descrição
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade de Put. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Participação cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, deverá ser maior que o Strike (%) e maior que 0.</p>
Barreira KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a barreira de <i>knock in</i> da Call Spread KI, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de <i>knock in</i> não seja atingida no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p>
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação da barreira de <i>knock in</i>.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (Europeia).</p> <p>Se indicado “Europeia”, apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana”, apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data inicial da janela de verificação da barreira de <i>knock in</i>. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data final da janela de verificação da barreira de <i>knock in</i>. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Data única”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados específicos – Figura COE 001052 – C Call + C Put KO + V PS KI

Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Participação cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente 2.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Barreira KIKO	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a barreira de KIKO, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação da barreira de KIKO.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (Europeia).</p> <p>Se indicado “Europeia”, apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana”, apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data inicial da janela de verificação da barreira de KIKO. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA</p>

Campo	Descrição
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data final da janela de verificação da barreira de KIKO. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

IMPORTANTE

A figura COE001053 – Retorno Condicional **possui apenas 1 campo específico da figura**. As demais informações acerca da remuneração da figura deverão constar nos campos fixos da tela de Registro/Emissão do COE.

Destacamos abaixo os campos com instruções de registro específicas para esta figura:

Dados específicos – Figura COE 001053 – Retorno Condicional

Deslocamento do accrual do DI	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar se haverá deslocamento no cálculo do accrual do DI, em relação a data de fluxo do COE*</p> <p>Campo com as opções de D-1 a D-30</p> <p>*: Para mais informações sobre o cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas – COE.</p>
-------------------------------	---

Campo	Descrição
Dados fixos da tela de Registro/Emissão do COE – Figura COE 001053 – Retorno Condicional	
Classe do Ativo Subjacente	<p>Campo onde é informada a classe do ativo subjacente a ser utilizado no COE.</p> <p>IMPORTANTE: das opções disponíveis, nesta figura só podem ser utilizadas as classes Títulos Privados ou Títulos Públicos.</p>
Ativo Subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções dos Ativos Subjacentes referentes à Classe do Ativo Subjacente selecionada anteriormente (Título Privado ou Título Público).</p>
Valor Inicial do Ativo Subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o PU de emissão do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 12 inteiros e 8 decimais</p>
Posição do emissor no derivativo	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se o emissor está comprado ou vendido no derivativo.</p> <p>IMPORTANTE: para essa figura, só poderá ser utilizada a posição do emissor “Vendido”.</p>
Remunerador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Representa o indexador que irá remunerar o COE.</p> <p>IMPORTANTE: para essa figura só podem ser utilizados os remuneradores Pré, DI, IPCA VCP, USD VCP e No período.</p>
Descrição Remunerador	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o remunerador indicado for IPCA VCP ou USD VCP.</p> <p>Formato: texto com 300 posições.</p>
Remunerador Flutuante (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o Remunerador for DI.</p> <p>Campo de preenchimento opcional se o Remunerador for IPCA VCP ou USD VCP.</p> <p>Indica a porcentagem de remuneração para DI, ou IPCA VCP e USD VCP quando houver.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Spread/Cupom (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o Remunerador indicado for Pré ou No Período.</p> <p>Campo de preenchimento opcional se o Remunerador indicado for DI, IPCA VCP ou USD VCP.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais.</p>

Campo	Descrição
Base	Campo de preenchimento obrigatório quando informado o campo Spread/Cupom (%).
Fluxo de Caixa	Caixa com as opções: “Sim” e “Não”. Indica se haverá pagamento de juros intermediários. A informação da obrigatoriedade de Fluxo de Caixa está indicada no dados variáveis das figuras aplicáveis.
Cotação Inicial Remunerador	Não pode ser preenchido se remunerador igual a DI, PRE e NO PERÍODO. Informar a cotação inicial do remunerador se este for IPCA VCP ou USD VCP.
Data Inicial Remunerador	Não pode ser preenchido se houver fluxo de caixa ou se o remunerador for DI, PRE e NO PERÍODO. Informar a data inicial do remunerador se ele for IPCA VCP ou USD VCP e o campo Cotação Inicial Remunerador não for preenchido. Não pode ser menor do que a data de emissão do COE ou a data de emissão a termo, caso preenchida. Deve ser dia útil do calendário nacional. Campo no formato DD/MM/AAAA.
Data Final Remunerador	Não pode ser preenchido se houver fluxo de caixa ou se o remunerador for DI, PRE e NO PERÍODO. Informar a data final do remunerador se ele for IPCA VCP ou USD VCP. Deve ser dia útil do calendário nacional. Campo no formato DD/MM/AAAA.
Resgate Antecipado	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a existência de condição de resgate antecipado. IMPORTANTE: das opções disponíveis, nesta figura só pode ser utilizada a “Condição específica”. Condição específica: Condição pré-definida pelo emissor do COE, que permite o resgate antecipado do IF caso a condição seja atingida.

Campo	Descrição						
Condição Específica de Resgate	<p>Campo de preenchimento obrigatório se for selecionado “Condição Específica” no campo “Resgate Antecipado”</p> <p>Indica a condição específica de resgate da emissão.</p> <p>Combo com domínios disponíveis conforme abaixo:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Domínios*</th> <th>Descrição</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Detalhadas nas documentações de emissão</td> <td>Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.</td> </tr> <tr> <td>Verificação de níveis de preço</td> <td>Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.</td> </tr> </tbody> </table>	Domínios*	Descrição	Detalhadas nas documentações de emissão	Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.	Verificação de níveis de preço	Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.
Domínios*	Descrição						
Detalhadas nas documentações de emissão	Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.						
Verificação de níveis de preço	Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.						

*: Os domínios são criados sob demanda do Emissor.

Entrega Física **IMPORTANTE:** nesta figura não haverá possibilidade de entrega física, portanto o campo deve ficar com preenchimento “vazio”.

Pagamento Extraordinário

Campo de preenchimento opcional.

IMPORTANTE: observar as condições permitidas para uso na função “Indicação de Pagamento Extraordinário”.

Opções de preenchimento: **Branco, Sim – Final e Sim – Fluxo.**

Em Branco: o sistema não gera pendência para lançamento de pagamento extraordinário.

Sim – Final: o sistema gera a operação de pagamento extraordinário na data de vencimento.

Sim – Fluxo: o sistema gera a operação de pagamento extraordinário nas datas de fluxo de caixa. Portanto, essa opção não pode ser utilizada para COE sem fluxo de caixa.

Dados específicos – Figura COE 001054 – Alocação Forwards KI

Para essa figura o campo “Remunerador” dos campos fixos do COE deve ser preenchido como “SEM REMUNERAÇÃO”, pois os dados do remunerador (taxa Pré) serão obrigatórios nos campos específicos.

Campo	Descrição
Campo	Descrição
	Campo de preenchimento obrigatório.
	Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.
	Indica como será formado o fixing no vencimento.
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas” Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”. Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.
Data para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas". A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”. Formato: DD/MM/AAAA.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas". Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento. Formato: DD/MM/AAAA.
Tipo de Cotação para Liquidação 1	Campo de preenchimento obrigatório. Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste
Limitador de alta global (%)	Campo de preenchimento opcional. Informar o limitador de alta global da estrutura, em percentual que deverá ser aplicado sobre o <i>notional</i> . Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.

Dados referente a Barreiras de KI – Americana Obrigatório

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras de KI.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data inicial da janela de verificação da barreira de KI. A partir de D-1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Data final da janela de verificação da barreira de KI. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Dados referente ao remunerador (Pré) da alocação – O percentual da alocação inicial é 100% obrigatoriamente	
Cupom remunerador adicional (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o cupom da taxa Pré em % a.a.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais.</p>
Base remunerador adicional	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: 252 EXP; 360 EXP; 360 LIN.</p>
Dados referente ao Forward KI 1	
Strike_KI 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o Strike e a Barreira de KI da FWD KI 1, em percentual. O percentual será aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i>.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero.</p>
Quantidade 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 1</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>

Campo	Descrição
Alocação 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a alocação do Nível 1 (em % do volume financeiro de emissão). Percentual do notional que será remunerado pela taxa Pré no Nível 1.</p> <p>A Alocação 1 deverá ser igual a:</p> <p>(100% - Q1)</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>

Dados referente ao Forward KI 2

Strike_KI 2	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar o Strike e a Barreira de KI da FWD KI 2, em percentual. O percentual será aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i>.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero e menor que o Strike_KI 1</p>
-------------	---

Quantidade 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 2</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>
------------------	---

Alocação 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a alocação do Nível 2 (em % do volume financeiro de emissão). Percentual do notional que será remunerado pela taxa Pré no Nível 2.</p> <p>A Alocação 2 deverá ser igual a:</p> <p>(100% - Q1 – Q2)</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>
----------------	--

Dados referente ao Forward KI 3

Strike_KI 3	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar o Strike e a Barreira de KI da FWD KI 3, em percentual. O percentual será aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i>.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero e menor que o Strike_KI 2</p>
-------------	---

Campo	Descrição
Quantidade 3 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 3</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>
Alocação 3 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a alocação do Nível 3 (em % do volume financeiro de emissão). Percentual do notional que será remunerado pela taxa Pré no Nível 3.</p> <p>A Alocação 3 deverá ser igual a:</p> <p>$(100\% - Q1 - Q2 - Q3)$</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>

Dados referente ao Forward KI 4

Strike_KI 4	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar o Strike e a Barreira de KI da FWD KI 4, em percentual. O percentual será aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i>.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero e menor que o Strike_KI 3</p>
Quantidade 4 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 4</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>
Alocação 4 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a alocação do Nível 4 (em % do volume financeiro de emissão). Percentual do notional que será remunerado pela taxa Pré no Nível 4.</p> <p>A Alocação 4 deverá ser igual a:</p> <p>$(100\% - Q1 - Q2 - Q3 - Q4)$</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>

Dados referente ao Forward KI 5

Campo	Descrição
Strike_KI 5	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar o Strike e a Barreira de KI da FWD KI 5, em percentual. O percentual será aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i>.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero e menor que o Strike_KI 4</p>
Quantidade 5 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 5</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>
Alocação 5 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se houver.</p> <p>Informar a alocação do Nível 4 (em % do volume financeiro de emissão). Percentual do notional que será remunerado pela taxa Pré no Nível 5.</p> <p>A Alocação 5 deverá ser igual a:</p> <p>(100% - Q1 – Q2 – Q3 – Q4 – Q5)</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>Máximo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Mínimo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Média no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p>

Dados específicos – Figura COE 001055 – CCallsSpread + VPutSpread + VPut

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Limitador Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Limitador da CallSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da CallSpread</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador Cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Limitador da PutSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da PutSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Participação cenário de baixa 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da Put.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção "Janela de Datas"</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo "Tipo de Fixing para Vencimento".</p> <p>Caso seja indicado "Mais Datas" as datas serão indicadas na seção "Mais Datas".</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for preenchido com "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Janela de Datas”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>Máximo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Mínimo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p> <p>Média no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.</p>

Dados específicos – Figura COE 001056 – Double Call KO + CallSpread

Campo	Descrição
-------	-----------

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.</p>

Informações referente a Call KO1

Participação cenário de Alta 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da Call KO1.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira no cenário de Alta 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a barreira de knock out da Call KO1, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1.</p> <p>Deverá ser maior que o Strike e menor que a barreira de KO2.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate no cenário de alta 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de KO1 seja atingida no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p>

Informações referentes a Call KO2

Participação cenário de Alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da Call KO2.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira no cenário de alta 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a barreira de knock out da Call KO2, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1.</p> <p>Deverá ser maior que a barreira de KO1 e menor que o Limitador.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>

Campo	Descrição
	Campo de preenchimento obrigatório.
Rebate no cenário de alta 2 (%)	Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de KO2 seja atingida no período de verificação. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.

Informações referentes a CallSpread

	Campo de preenchimento obrigatório.
Participação cenário de Alta 3 (%)	Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da CallSpread. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
	Campo de preenchimento obrigatório.
Limitador Cenário de Alta (%)	Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Limitador da CallSpread. Deverá ser maior que a barreira de KO2. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.

Informações referentes ao ativo e a verificação de barreiras

	Campo de preenchimento obrigatório.
	Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.
	Indica como será formado o fixing no vencimento.
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção "Janela de Datas" Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo "Tipo de Fixing para Vencimento". Caso seja indicado "Mais Datas" as datas serão indicadas na seção "Mais Datas".
Data para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for preenchido com "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for preenchido com "Janela de Datas". A partir de D+1 da "Data de Emissão" (ou "Emissão a Termo"), e menor que "Data Final para Fixing". Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Janela de Datas”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação 1	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste</p>
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras de knock out.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (Europeia).</p> <p>Se indicado “Europeia”, apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana”, apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data inicial da janela de verificação da barreira de knock out. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA</p>
Data final para verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data final da janela de verificação da barreira de knock out. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” .</p> <p>Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como <i>fixing</i> do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como <i>fixing</i> do evento.

Dados específicos – Figura COE 001057 – Retorno Condicional 2

IMPORTANTE

A figura 57 – Retorno Condicional 2 **possui apenas 1 campo específico da figura**. As demais informações acerca da remuneração da figura deverão constar nos campos fixos da tela de Registro/Emissão do COE.

Destacamos abaixo os campos com instruções de registro específicas para esta figura:

Campo	Descrição
Dados Específicos – COE001057 – Retorno Condicional 2	
Deslocamento do <i>accrual</i> do DI	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar se haverá deslocamento no cálculo do <i>accrual</i> do DI, em relação a data de vencimento do COE*</p> <p>Campo com as opções de D-1 a D-30</p> <p>*: Para mais informações sobre o cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas – COE.</p>

Dados Fixos da tela de Registro/Emissão do COE–COE001057–Retorno Condicional 2

Campo	Descrição
Classe do Ativo Subjacente	<p>Campo onde é informada a classe do ativo subjacente a ser utilizado no COE.</p> <p>IMPORTANTE: das opções disponíveis, nesta figura só podem ser utilizadas as classes Títulos Privados ou Títulos Públicos.</p>
Ativo Subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções dos Ativos Subjacentes referentes à Classe do Ativo Subjacente selecionada anteriormente (Título Privado ou Título Público).</p>
Valor Inicial do Ativo Subjacente	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o PU de emissão do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 12 inteiros e 8 decimais</p>
Posição do emissor no derivativo	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se o emissor está ativo ou passivo no derivativo.</p> <p>IMPORTANTE: das opções disponíveis, nesta figura só pode ser utilizada a posição do emissor “Vendido”.</p>
Remunerador	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Representa o indexador que irá remunerar o COE.</p> <p>IMPORTANTE: das opções disponíveis, nesta figura só podem ser utilizados os remuneradores Pré, DI, IPCA VCP, USD VCP e No período.</p>
Descrição Remunerador	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o remunerador indicado for IPCA VCP ou USD VCP.</p> <p>Formato: texto com 300 posições.</p>
Remunerador Flutuante (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o Remunerador for DI.</p> <p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver, se o Remunerador for IPCA VCP ou USD VCP.</p> <p>Indica a porcentagem de remuneração para DI, ou IPCA VCP e USD VCP quando houver.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Spread/Cupom (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório se o Remunerador indicado for Pré ou No Período.</p> <p>Campo de preenchimento obrigatório, quando houver, se o Remunerador indicado for DI, IPCA VCP ou USD VCP.</p> <p>Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais.</p>
Base	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando informado o campo Spread/Cupom (%).</p> <p>Não preencher se remunerador indicado for “No Período”.</p> <p>Campo para informar a base do cupom do Remunerador.</p> <p>Campo com as opções: 252 exp, 360 exp e 360 lin.</p>
Cotação Inicial Remunerador	<p>Não pode ser preenchido se remunerador igual a DI, PRE e NO PERÍODO.</p> <p>Informar a cotação inicial do remunerador se este for IPCA VCP ou USD VCP.</p>
Data Inicial Remunerador	<p>Não pode ser preenchido se houver fluxo de caixa ou se o remunerador for DI, PRE e NO PERÍODO.</p> <p>Informar a data inicial do remunerador se ele for IPCA VCP ou USD VCP e o campo Cotação Inicial Remunerador não for preenchido.</p> <p>Não pode ser menor do que a data de emissão do COE ou a data de emissão a termo, caso preenchida.</p> <p>Deve ser dia útil do calendário nacional.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA.</p>
Data Final Remunerador	<p>Não pode ser preenchido se houver fluxo de caixa ou se o remunerador for DI, PRE e NO PERÍODO.</p> <p>Informar a data final do remunerador se ele for IPCA VCP ou USD VCP.</p> <p>Deve ser dia útil do calendário nacional.</p> <p>Campo no formato DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição						
Resgate Antecipado	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica a existência de condição de resgate antecipado.</p> <p>IMPORTANTE: das opções disponíveis, nesta figura só pode ser utilizada a “Condição específica”.</p> <p>Condição específica: Condição pré-definida pelo emissor do COE, que permite o resgate antecipado do IF caso a condição seja atingida.</p>						
Condição Específica de Resgate	<p>Campo de preenchimento obrigatório se for selecionado “Condição Específica” no campo “Resgate Antecipado”</p> <p>Indica a condição específica de resgate da emissão.</p> <p>Combo com domínios disponíveis conforme abaixo:</p>						
<table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="505 745 886 808">Domínios*</th> <th data-bbox="886 745 1271 808">Descrição</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="505 808 886 1045">Detalhadas nas documentações de emissão</td> <td data-bbox="886 808 1271 1045">Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.</td> </tr> <tr> <td data-bbox="505 1045 886 1344">Verificação de níveis de preço</td> <td data-bbox="886 1045 1271 1344">Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.</td> </tr> </tbody> </table>		Domínios*	Descrição	Detalhadas nas documentações de emissão	Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.	Verificação de níveis de preço	Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.
Domínios*	Descrição						
Detalhadas nas documentações de emissão	Indica que os eventos de crédito e/ou demais eventos/cláusulas são definidos nas documentações de suporte da emissão.						
Verificação de níveis de preço	Indica que os eventos/cláusulas de resgate antecipado no valor de mercado do COE, relacionados a verificação de preço do ativo subjacente, são definidos nas documentações de suporte da emissão.						
*: Os domínios são criados sob demanda do Emissor.							
Entrega Física	<p>Campo habilitado quando a classe do ativo for Títulos Privados. Quando for Títulos Públicos, o campo não será habilitado.</p> <p>IMPORTANTE: nesta figura não haverá possibilidade de entrega física, portanto o campo deve ficar com preenchimento “vazio”.</p>						
Fluxo de Caixa	<p>Caixa com as opções: “Sim” e “Não”.</p> <p>Indica se haverá pagamento de juros intermediários.</p> <p>IMPORTANTE: nesta figura não haverá possibilidade de Indicar Fluxo de Caixa. Portanto o campo deve ficar com preenchimento “Não”.</p>						

Campo	Descrição
Pagamento Extraordinário	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>IMPORTANTE: observar as condições permitidas para uso na função “Indicação de Pagamento Extraordinário”.</p> <p>Opções de preenchimento: Branco, Sim – Final e Sim – Fluxo.</p> <p>Em Branco: o sistema não gera pendência para lançamento de pagamento extraordinário.</p> <p>Sim – Final: o sistema gera a operação de pagamento extraordinário na data de vencimento.</p> <p>Sim – Fluxo: o sistema gera a operação de pagamento extraordinário nas datas de fluxo de caixa. Portanto, essa opção não pode ser utilizada para COE sem fluxo de caixa, o que é o caso dessa figura.</p>

Dados específicos – Figura COE 001058 – Put KI + Callspread

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade de opções. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Participação cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Limitador cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o limitador de alta do Callspread, em percentual, a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, deverá ser maior que o Strike (%) e maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Barreira KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a barreira de knock in da Put, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>
Rebate KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de knock in não seja atingida no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (Europeia).</p> <p>Se indicado “Europeia”, apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana”, apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data inicial da janela de verificação da barreira de <i>knock in</i>. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data final da janela de verificação da barreira de <i>knock in</i>. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica se no fechamento da operação, os ativos subjacentes serão liquidados por uma data única ou pela média asiática de um período de datas.</p> <p>Campo com as opções: Data Única e Janela de Datas.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Data única”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Tipo de cotação para verificação de barreira cenário de baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>
Participação cenário de baixa (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas”.</p> <p>Campo com os domínios: Máxima Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como fixing do evento. • Mínimo no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como fixing do evento. • Média no período: O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como fixing do evento.

Dados específicos - Figura COE 001059 – CCall KO Cond + VPut KI Double Bkt

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike da call, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade de opções. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>

Campo	Descrição
Participação cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Tem KO Condicional?	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar se a opção “Call” possui barreira de KO.</p> <p>Se sim, a barreira de KO é condicional à barreira de KI da Put, ou seja, são verificadas em conjunto. (por ex.: caso o KI seja atingido, o KO também é atingido.)</p> <p>Campo com as opções: Sim e Não</p>
Rebate KO (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de knock out seja atingida no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p>
Dados da VPut KI	
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike da put, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade de opções. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Participação cenário de Baixa (%)	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Barreira KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar a barreira de knock in da Put, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.</p>

Campo	Descrição
Rebate KI (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de knock in não seja atingida no período de verificação.</p> <p>Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.</p>
Período de verificação de barreiras	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Americana e Europeia. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (Europeia).</p> <p>Se indicado “Europeia”, apenas a “Data para Fixing” pode ser preenchido. Se indicado “Americana”, apenas a “Data Inicial para Verificação” e “Data Final para Verificação” podem ser preenchidos.</p>
Data Inicial para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data inicial da janela de verificação da barreira de <i>knock in</i>. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”) e menor que “Data Final para Verificação”</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA</p>
Data Final para Verificação	<p>Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”.</p> <p>Data final da janela de verificação da barreira de <i>knock in</i>. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de cotação para verificação de barreira cenário de baixa	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Dados dos ativos subjacentes

Tipo de Cesta da Call	<p>Informar o tipo de cesta da Call. Não pode ser o mesmo tipo de cesta indicado no campo “Tipo de Cesta da Put KI”.</p> <p>Campo com as opções: Standard, Best Of e Worst Of</p> <p>A parametrização da cesta tipo “Standard” deve ocorrer na função de Cestas existente do COE.</p>
-----------------------	---

Campo	Descrição
Tipo de Cesta da Put KI	<p>Informar o tipo de cesta da Put KI. Não pode ser o mesmo tipo de cesta indicado no campo “Tipo de Cesta da Call”.</p> <p>Campo com as opções: Standard, Best Of e Worst Of</p> <p>A parametrização da cesta tipo “Standard” deve ocorrer na função de Cestas existente do COE.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório. Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas”.</p> <p>Campo com os domínios: Máxima Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>Máximo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como fixing do evento.</p> <p>Mínimo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como fixing do evento.</p> <p>Média no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como fixing do evento.</p>

Dados específicos - Figura COE 001060 – CCallSpread + VPutSpread

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Limitador Cenário de Alta (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Limitador da CallSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>

Campo	Descrição
Participação de Alta (%)	<p>cenário Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Participação da CallSpread</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>
Limitador Baixa (%)	<p>Cenário de Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Limitador da PutSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Participação de Baixa (%)	<p>cenário Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da PutSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas.</p> <p>Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Data única".</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com "Janela de Datas".</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente.</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.</p>

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas”.</p> <p>Campo com os domínios: Máxima Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> <p>Máximo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como fixing do evento.</p> <p>Mínimo no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como fixing do evento.</p> <p>Média no período:</p> <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como fixing do evento.</p>

Dados específicos - Figura COE 001061 – CCall + VPutSpread

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 1	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.</p>

Campo	Descrição
Participação de Alta (%)	<p>cenário Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.</p> <p>Participação da CallSpread</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Strike 2 (%)	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Quantidade 2	<p>Campo de preenchimento opcional.</p> <p>Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.</p> <p>Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais..</p>
Limitador Baixa (%)	<p>Cenário de Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Limitador da PutSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.</p>
Participação de Baixa (%)	<p>cenário Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da PutSpread.</p> <p>Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.</p>
Campo	Descrição
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Campo com as opções: Data Única, Janela de Datas e Mais Datas. Indica como será formado o fixing no vencimento.</p> <p>Caso o ativo subjacente seja uma Cesta, não é permitido selecionar a opção “Janela de Datas”</p> <p>Se indicado Janela de Datas ou Mais Datas, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing para Vencimento”.</p> <p>Caso seja indicado “Mais Datas” as datas serão indicadas na seção “Mais Datas”.</p>

Campo	Descrição
Data para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Data única”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data inicial para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Janela de Datas”.</p> <p>A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Data final para fixing	<p>Campo de preenchimento obrigatório, se campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Janela de Datas”.</p> <p>Esta data deve ser posterior à indicada no campo “Data Inicial para Fixing”, e inferior a data de vencimento.</p> <p>Formato: DD/MM/AAAA.</p>
Tipo de Cotação para Liquidação	<p>Campo de preenchimento obrigatório.</p> <p>Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente</p> <p>Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste</p>
Tipo de Fixing para Vencimento	<p>Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas”.</p> <p>Campo com os domínios: Máxima Período, Mínima no Período e Média no Período</p> <p>Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE.</p> <ul style="list-style-type: none"> • Máximo no período: <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a maior cotação do intervalo como fixing do evento.</p> • Mínimo no período: <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a menor cotação do intervalo como fixing do evento.</p> • Média no período: <p>O sistema irá verificar a cotação de todas as datas do intervalo da “Data fixing” (inclusive) até a “Data Fixing 2” (inclusive) e utilizará a média de todas as cotações do intervalo como fixing do evento.</p>

Operação de intermediação no mercado primário para COE

Em Registro de Operação – Depósito e Compra/Venda Definitiva

A intermediação praticada no âmbito da B3 é a atividade em que um Participante atua entre as partes de uma negociação, de modo a auferir resultado financeiro positivo ou nulo, sem a assunção, relativamente às obrigações inerentes à operação, de qualquer tipo de risco de crédito, de mercado ou de liquidez.

Caracteriza-se como intermediação no mercado primário a associação de uma operação de depósito com uma de venda definitiva de títulos, efetuada pelo participante Intermediador, identificado pela conta XXXXX. 69-X com liquidação financeira na modalidade Multilateral/Cetip e Bruta STR.

COE Simplificado

COE Simplificado é o certificado que pelos motivos abaixo não é calculado automaticamente pela B3.

Motivos que tornam um COE simplificado:

1. COE com Entrega Física igual "SIM";
2. COE alterado depois de Depositado;
3. COE com Lookback, somente se for alterado o valor inicial do ativo-subjacente através da função "Atualização de PU", pelo motivo "Valores Lookback";
4. COE registrado com uma Figura não-calculada.
5. COE registrado com Funcionalidade que torna o COE simplificado (para mais detalhes, consultar a seção **Funcionalidade**)

Transferência de IF sem Financeiro

Através desta função, pode-se solicitar a transferência sem o financeiro do COE entre contas de diferentes instituições ou entre as contas "Cliente 1" e "Cliente 2" de uma mesma instituição

A função está disponível no módulo de Títulos e Valores Mobiliários > Cadastramento de Operações > Transferência de I.F Sem Financeiro > Solicitação.

Para maiores esclarecimentos, esta função encontra-se detalhada no Manual de Operações – Funções TVM.

Ativos subjacentes

A relação completa de ativos subjacentes disponíveis para o COE pode ser encontrada no arquivo “AAAAMMDD_Ativos_Subjacentes.txt”, que tem atualização diária. Esse arquivo pode ser acessado de duas formas:

1. Acesso via sistema NoMe – Menu>Transfe. de Arquivo>Arquivo>Arquivos Públicos
2. Acesso via FTP - ftp://ftp.cetip.com.br/Public/

Para solicitar a análise da possibilidade de incluir um novo ativo nesta lista, basta enviar a demanda para o e-mail para indices@b3.com.br.

Abaixo seguem mais informações sobre a utilização de alguns ativos-subjacentes especiais. Qualquer dúvida quanto a sua utilização, favor contatar a B3 através do email coe@b3.com.br.

Índices Proprietários

É de responsabilidade do Emissor obter as eventuais licenças e/ou autorizações exigidas pela entidade responsável pela apuração do índice proprietário para utilização, do referido índice, como ativo subjacente do COE do Emissor.

A metodologia utilizada para apuração do índice proprietário é de exclusiva responsabilidade do Emissor.

Ativos exclusivos

Os ativos subjacentes apresentados na tabela 1 foram criados com o propósito meramente operacional (portanto, não há nenhuma captura). A utilização desses ativos deve ser feita somente com a Figura que tenha a mesma numeração.

Para as Figuras citadas, os ativos subjacentes específicos são indicados nos respectivos campos variáveis.

Tabela 1 – Ativos Exclusivos

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Valor Inicial do Ativo Subjacente	Figura
ATIVOCOE39	ÍNDICES	10.000	39 - Call Spread + Put Spread
ATIVOCOE40	ÍNDICES	10.000	40 - Put Spread + Put Spread
ATIVOCOE45	ÍNDICES	10.000	45 – Troca de indexadores

Índices

Os ativos subjacentes apresentados na tabela 2 são índices criados pela acumulação da Taxa DI-Cetip, mas com algumas diferenças.

Tabela 2 - Índices

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Capturado automaticamente?	Número-índice base	Data Base	Divulgação
<i>INDICE DI</i>	ÍNDICES	Sim	10.000	02/01/2008	www.b3.com.br
<i>IDI BMF D0</i>	ÍNDICES	Sim	100.000	02/01/2009	www.b3.com.br
<i>IDI BMF *</i>	ÍNDICES	Não	100.000	02/01/2009	www.b3.com.br

Tabela 2 – Índices

* Neste índice, a data de referência do número-índice é sempre D+1 do *IDI BMF D0*. Por exemplo, neste índice, o valor do número-índice de 02/03/201X será igual ao valor do número-índice de 03/03/201X do índice *IDI BMF D0*.

Taxas de Juros em Cesta de ativos

Os ativos subjacentes apresentados na tabela 3 foram criados exclusivamente para utilização combinada em **cesta** do tipo *Best/Worst of*.

Tabela 3 – Ativos Subjacentes de Juros para Cesta

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Capturado automaticamente?	Valor Inicial do Ativo-Subjacente
<i>TAXA DI</i>	JUROS	Não	Informar o % da Taxa DI-Cetip a ser acruado
<i>TX PERÍODO</i>	JUROS	Não	Informar o valor da taxa pré-fixada no período

Tabela 3 – Taxas de juros em Cesta de ativos

Ativos subjacentes com memória*

Os ativos subjacentes apresentados na tabela 4 foram criados com o objetivo de refletir a melhor cotação para liquidação de “n” datas de observação.

Para replicar esse mecanismo deve utilizar, junto com o ativo “MB”, a funcionalidade de Fluxo de Caixa e indicar as datas de verificação no campo “Data fixing”.

Tabela 4 – Ativos Subjacentes Com Memória

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Capturado automaticamente
PINEEHAMB	Índices	Não
SPECFR6PMB	Índices Internacionais	Não

Sendo:

MB (Memória Best): Será considerada a maior cotação em “n” datas de observação.

*Válido somente para contratos em estoque emitidos com esses ativos. Para novas emissões, verificar a função de **Mais Datas**,

Ativos subjacentes com memória alavancada

Os ativos subjacentes “**MA**” apresentados na tabela 5 foram criados com o objetivo de refletir a melhor performance alavancada, verificada em “n” datas de observação, para a liquidação no vencimento do COE. Isto é, será considerado o maior resultado obtido na multiplicação da performance do ativo na respectiva data de observação pelo respectivo percentual de alavancagem.

Para replicar esse mecanismo é necessário utilizar a classe do ativo subjacente “**CESTA**” e indicar o tipo de cesta “**Spread**”. A quantidade de ativos da cesta deverá refletir a quantidade de datas de observação, sendo no máximo 20. No registro das informações da cesta, é necessário repetir o mesmo ativo não calculado “XPTO4MA” para cada data de observação. O campo “Peso %” indicará a **alavancagem** da performance do ativo na respectiva data de observação e o campo “Data fixing” indicará as **datas de observação**.

Como a cesta não será calculada (uma vez que os ativos que a compõe também não serão), deverá ser feita a **atualização de PU** indicando o valor final da Cesta o qual refletirá a performance final do COE.

Tabela 5 – Ativos Subjacentes com Memória Alavancada

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Capturado automaticamente
MSFDMSV9MA	Índices Internacionais	Não

Sendo:

MA (Memória Alavancada): Será considerada a maior performance alavancada em “n” datas de observação.

Ativos subjacentes “_43”

Os ativos subjacentes apresentados na tabela 7 foram criados exclusivamente para utilização na figura COE001043 – Edge Accrual, combinada com as funcionalidades de Indicação de **Pagamento Extraordinário** nas datas de evento e **Fluxo de Caixa com barreira de chamada**,

Nesse mecanismo, caso seja disparada a barreira de chamada em alguma data de evento, a remuneração será calculada de acordo com a metodologia da figura COE001043 – Edge Accrual proporcional ao período observado, e será informada por meio da ferramenta de **Pagamento Extraordinário**.

Tabela 7 – Ativos Subjacentes “43”

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Capturado automaticamente
BABA UN_43	Ações Internacionais	Não
CSCO UW_43	Ações Internacionais	Não
NFLX UW_43	Ações Internacionais	Não
6758 JT_43	Ações Internacionais	Não
EA UW_43	Ações Internacionais	Não
TTWO UW_43	Ações Internacionais	Não
7974 JT_43	Ações Internacionais	Não
ATVI UW_43	Ações Internacionais	Não
BBDC4_43	Ações Nacionais	Não
JBSS3_43	Ações Nacionais	Não
LREN3_43	Ações Nacionais	Não
PETR4_43	Ações Nacionais	Não

Ativos subjacentes *Watermark Performance**

Os ativos subjacentes apresentados na tabela 8 foram criados exclusivamente para utilização em estruturas em que, nas datas de evento intermediárias, a remuneração será a performance do ativo excedente em relação à melhor performance observada nas datas de evento anteriores, desde que positiva.

Para replicar esse mecanismo, devem ser utilizadas, junto com o ativo “WP”, as funcionalidades de **Fluxo de Caixa** e Indicação de **Pagamento Extraordinário** no fluxo.

Tabela 8 – Ativos Subjacentes WP

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Capturado automaticamente
CSEAEMTR_WP	Ações Internacionais	Não
ENHAEMOK_WP	Índices Internacionais	Não

*Válido somente para contratos em estoque emitidos com esses ativos. Para novas emissões, verificar o item **Funcionalidades – Watermark Performance**,

Ativos subjacentes com Performance Acumulada (“_PA”)*

Os ativos subjacentes apresentados na tabela 9 foram criados para refletir a performance acumulada nas datas de evento. Devem ser utilizados em conjunto com a ferramenta de Fluxo de Caixa.

Nas datas de evento, o emissor deverá informar na função de Atualização do PU o valor do ativo correspondente à performance acumulada, contabilizando como “zero” as performances negativas. Exemplo:

Valor inicial do ativo: 100

	Performance	Performance acumulada	Valor do ativo
Fluxo 1	-3%	0%	100
Fluxo 2	-5%	0%	100
Fluxo 3	4%	4%	104
Fluxo 4	-1%	4%	104
Fluxo 5	7%	11%	111
Vcto	2%	13%	113

Tabela 9 – Ativos Subjacentes “_PA”

Ativo Subjacente	Classe do Ativo Subjacente	Capturado automaticamente
AIR FP_PA	Ações Internacionais	Não
VIV FP_PA	Ações Internacionais	Não
MC FP_PA	Ações Internacionais	Não
MT NA_PA	Ações Internacionais	Não

*Válido somente para contratos em estoque emitidos com esses ativos. Para novas emissões, verificar o item **Funcionalidades – Performance Acumulada**,

Funcionalidade

O campo “**Funcionalidade**”, indicado no registro do COE, tem como objetivo disponibilizar diferentes formas de remuneração, cálculo de performance e outras funções demandas pelo mercado que podem ser atreladas ao *payoff* do COE.

Os domínios disponíveis estão detalhados abaixo e a solicitação de **novas funcionalidades** pode ser realizada para o time de **Produtos – Derivativos e COE**, através dos contatos:

- Telefones: (11) 2565-5966/5956/5954/5950/6532
- E-mail: derivativo@b3.com.br

Domínios disponíveis e detalhamento:

1) Watermark Performance:

Estruturas em que nas **datas de evento** do COE o cálculo do **Remunerador no fluxo** será a performance do ativo subjacente excedente em relação à melhor performance observada nas datas de evento anteriores, desde que positiva.

Para utilização dessa funcionalidade:

- É obrigatória a indicação de **Fluxo de Caixa e Remunerador no Fluxo**.
- Será necessário realizar o **lançamento do PU do Remunerador no fluxo**, em que o valor corresponda ao pagamento de cada fluxo de acordo com a metodologia de cálculo da funcionalidade.

Para mais informações sobre o cálculo da funcionalidade, consultar o Caderno de Fórmulas – Seção de Funcionalidades.

2) Performance Acumulada:

Estruturas em que nas **datas de evento intermediárias** (fluxo de caixa) a verificação das **barreiras** do COE será com base na performance acumulada do ativo subjacente, ou seja, a cada data de evento intermediária, sempre que a performance do ativo for positiva, ela será somada à performance das datas de evento anteriores, e as performances negativas serão contabilizadas como “zero”.

Para utilização dessa funcionalidade:

- É **obrigatória** a indicação de **Fluxo de Caixa e Barreiras** (Barreira Cupom (%) e/ou Barreira Chamada (%)).
- Será necessário realizar o **lançamento da cotação do ativo subjacente** nas datas de evento intermediárias em que o valor da cotação corresponda performance acumulada até a data do evento.

Para mais informações sobre o cálculo da funcionalidade, consultar o Caderno de Fórmulas – Seção de Funcionalidades.

IMPORTANTE: As funcionalidades podem:

- **Desligar o cálculo do ativo subjacente do COE:** Será necessário realizar o lançamento da cotação do ativo nas datas de evento do COE, com o valor final correspondente ao cálculo de cada funcionalidade.
- **Tornar o COE simplificado:** Será necessário realizar o lançamento do PU para COE simplificado na data de vencimento do COE, com o valor final correspondente ao cálculo de cada funcionalidade.

Funcionalidade	Desliga o cálculo do ativo?	Torna o COE simplificado?
WATERMARK PERFORMANCE	NÃO	NÃO
PERFORMANCE ACUMULADA	SIM	NÃO

Cestas

Os domínios disponíveis para o campo “Tipo de Cesta” indicado na função de Paramerização de Cesta estão detalhados abaixo e a solicitação de **novos tipos de Cesta** pode ser realizada para o time de **Produtos – Derivativos e COE**, através dos contatos:

- Telefones: (11) 2565-5966/5956/5954/5950/6532
- E-mail: derivativo@b3.com.br

Domínios disponíveis e detalhamento:

- **WORST OF:** mecanismo em que a performance da Cesta será a performance do **pioor** ativo subjacente.
- **BEST OF:** mecanismo em que a performance da Cesta será a performance do **melhor** ativo subjacente.
- **STANDARD:** mecanismo em que a performance da Cesta será calculada com a performance de todos os ativos, multiplicada pelo seu respectivo **Peso (%)** indicado no registro. Nessa cesta, o peso dos ativos deve ser positivo e somar 100%
- **SPREAD:** mecanismo em que a performance da Cesta será calculada com a performance de todos os ativos, multiplicada pelo seu respectivo **Peso (%)** indicado no registro. Nessa cesta, o peso dos ativos pode ser positivo ou negativo e o somatório dos pesos pode assumir qualquer valor.
- **RAINBOW:** mecanismo em que os pesos dos ativos da cesta serão atribuídos conforme a performance de cada ativo (ativo com maior performance recebe o maior peso; ativo com segunda maior performance recebe o segundo maior peso, e assim por diante). Nessa cesta, o peso dos ativos pode ser positivo ou negativo e o somatório dos pesos pode assumir qualquer valor.**MEMORIZER:** mecanismo em que em cada ativo da cesta é analisando individualmente se atingiu as condições de barreira, dessa forma, a barreira é disparada quando o último ativo atender os condicionantes de barreira (ACIMA, ABAIXO ou ENTRE). Nessa cesta, o peso dos ativos pode ser positivos ou negativos e o somatório dos pesos pode assumir qualquer valor.

Para mais informações sobre o cálculo da funcionalidade, consultar o Caderno de Fórmulas na Seção de Funcionalidades.