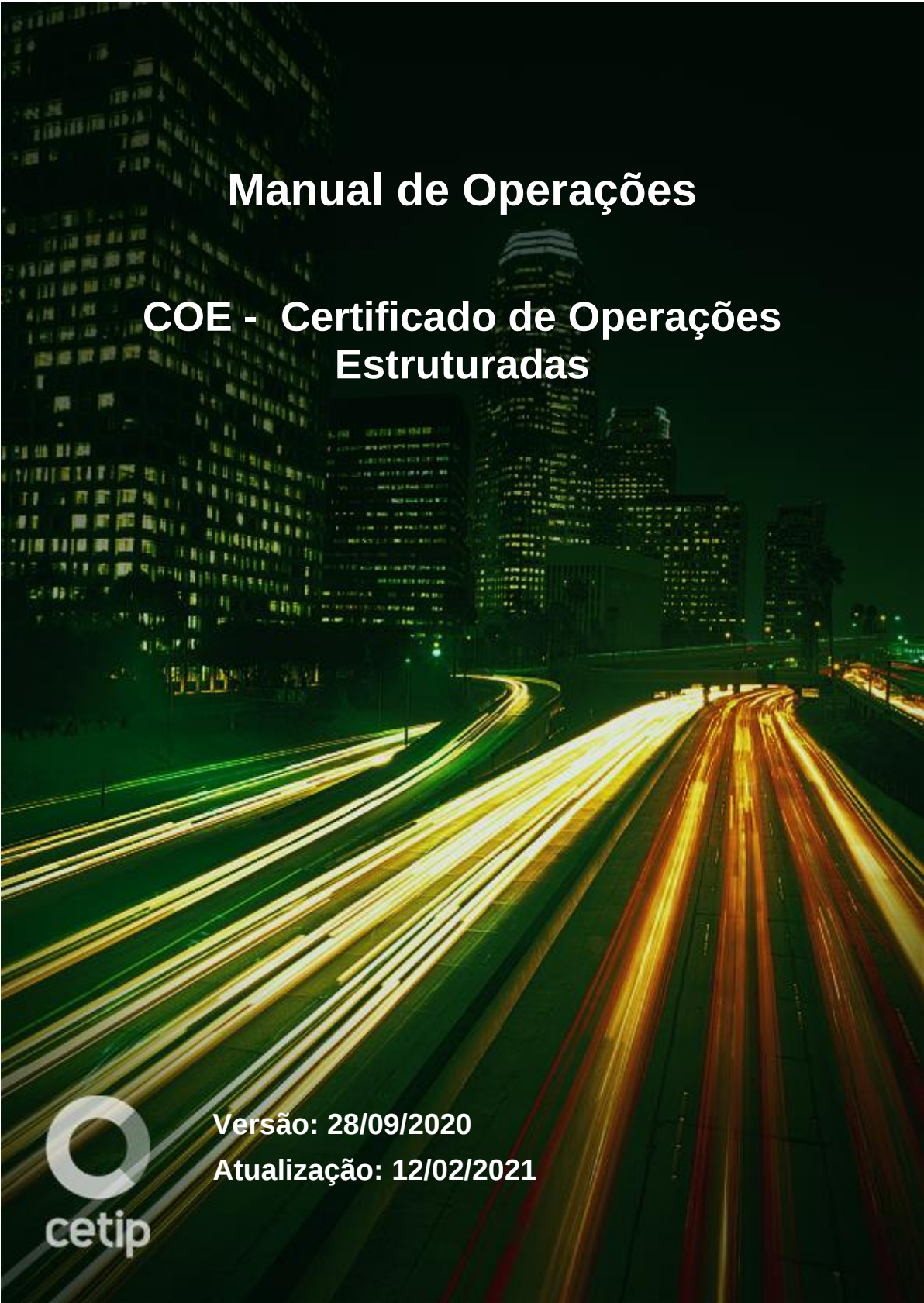




Manual de Operações

COE - Certificado de Operações Estruturadas



Versão: 28/09/2020

Atualização: 12/02/2021

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	71
Atualização de Valores de Notional (“Análise de Sensibilidade”).....	73
Garantia	75
Cancelamento Retroativo de Operação de Depósito.....	77
Indicação de Entrega Física	78
Manutenção do Código ISIN	80
Parametrização de Cestas	81
Indicação de Pagamento Extraordinário.....	86
Lançamento de Datas para Fixing (Mais Datas).....	88
Vinculação de Reserva Técnica	90
Antecipação de Desvinculação de Reserva Técnica	92
Consultas	95
Consulta de Marcação a Mercado.....	96
Consulta COE	97
Consulta de Ativo Subjacente	101
Consulta de Notional Máximo e Mínimo (“Análise de Sensibilidade”)	102
Consulta de Agenda Fluxo de Caixa COE	103
Pendências de Marcação a Mercado e Sensibilidade	105
Consulta Cesta	106

Consulta de Operações de Atualização de PU.....	107
Consulta de “Mais Datas” para Fixing	108
Informações Adicionais	109
Ativos x Naturezas Econômicas	110
Anexo – Descrição dos campos das figuras.....	111
Operação de intermediação no mercado primário para COE	288
COE Simplificado	289
Transferência de IF sem Financeiro	290
Ativos subjacentes	291
Funcionalidade.....	296
Cestas.....	298

Atualizações da Versão

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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
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

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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.
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.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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.
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.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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.
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”

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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.
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 figuras	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”.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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.
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.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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.
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.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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 IBOVESPA VCP, USD VCP e USD.
20/10/2014	20/10/2014	Registro do COE	Exclusão das restrições nos campos de Remunerador do COE.
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.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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	08/01/214	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.
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.

Versão	Atualizado em	Referência	Atualização
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.

Oferta Pública ICVM 569

Caso o COE seja emitido sob esta instrução, essa informação deve ser declarada no momento do registro através do campo “Instrução CVM 569”.

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 Segmento CETIP UTM, 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			
Tipo de COE	COE001001 - Call		
Classe do Ativo Subjacente	CESTA		
Ação	INCLUIR		
Confirmar Limpar Campos 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	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 Onde: MM – É o Mnemônico da Instituição Financeira responsável pela emissão do COE, FF – Refere-se a figura (ou payoff) de um determinado COE, AA – É referente ao ano de emissão deste COE, M – Refere-se ao Mês de emissão do COE, SSSS – É referente ao código sequencial de cada COE. Nos casos de alteração e exclusão o Código do IF é de preenchimento obrigatório. 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.	Sim para Alteração e Exclusão

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 Estruturada

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 	
Ativo Subjacente SELECIONE v	Data de Emissão 	
Data de Vencimento 	Quantidade Emitida 	
Valor Unitário de Emissão 	Valor Financeiro de Emissão 	
Capital Garantido (%) 	Valor Inicial do Ativo Subjacente 	
Data Emissão a termo 	Código ISIN 	
Modalidade 	Base Aplicação (%) 	
Instrução CVM 569 	Conta Escriturador 	
Proteção contra proventos 	Posição do emissor no derivativo 	
Tipo de Regime 	Remunerador no Vencimento 	
Descrição remunerador 	Remunerador Flutuante (%) 	
Spread/Cupom (%) 	Base 	
Cotação Inicial Remunerador 	Data Inicial Remunerador 	
Data Final Remunerador 	Resgate antecipado 	
Condição Específica de Resgate 	Cláusula de Resgate pelo Emissor 	
Código Identificador 	Entrega Física 	
Descrição Entrega Física 	Pagamento Extraordinário 	
Funcionalidade 	Fluxo de Caixa Não	
Lookback 	Critério de Lookback 	
Data Inicial de Lookback 	Data Final de Lookback 	
Operação de Depósito		
Conta do Favorecido 	CPF/CNPJ (Cliente) 	Natureza (Cliente)
Meu número 	P.U. 	Modalidade
Liquidante 		
Dados específicos		
Strike 1(%) 		
Quantidade 1 		
Participação cenário de alta (%) 		
Período de captura do ativo subjacente para liquidação Data inicial para fixing Data final para fixing Data para fixing	SELECIONE v 	
Tipo de Cotação para Liquidação Tipo de Fixing para Vencimento	SELECIONE v SELECIONE v	
Enviar Limpar Campos Voltar 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	Para os ativos subjacentes não calculados, é obrigatório o preenchimento. 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. 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. 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. Caso o COE seja emitido a termo, este campo poderá ser preenchido de 2 maneiras: • 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. Formato: numérico com 12 inteiros e 8 decimais.
Data Emissão a Termo	Campo referente a data de início de um COE a termo. Campo opcional, só devendo ser preenchido nos casos de COE a Termo. Formato: DD/MM/AAAA.
Código ISIN	Campo de preenchimento opcional. Formato: alfanumérico com 12 posições.
Modalidade	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Capital Investido Garantido e Perda Limitada ao Capital Investido. Quando “Capital Investido Garantido”: Capital Garantido deverá ser maior ou igual à 100% Quando “Perda Limitado ao Capital Investido”: Capital Garantido deverá ser maior ou igual a 0 e menor que 100%.
Base Aplicação (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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.

Campo	Descrição
Instrução CVM 569	Campo de preenchimento obrigatório. O campo deve se preenchido com SIM apenas para os registros de IF que forem objeto de oferta pública.
Conta Escriturador	Campo deverá ser mantido vazio/em branco.
Proteção contra Proventos	Campo disponível para Ações Nacionais e Internacionais. Se a classe do Ativo Subjacente for Ações Nacionais, o campo vem com as opções “Sim – Ajustado pelo Emissor”, “Sim – Cetip” e “Não”. 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”. Se a classe do Ativo Subjacente for Ações Internacionais, o campo vem com as opções “Sim – Ajustado pelo Emissor” e “Não”. Para qualquer tipo de evento das Ações Internacionais o sistema não irá ajustar o Valor Inicial do Ativo Subjacente. 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. 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. A opção “Sim – Cetip” não pode ser escolhida no caso de Lookback.
Posição do emissor no derivativo	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Comprado e Vendido. Indica se o emissor está comprado (ativo) ou vendido (passivo) no derivativo.
Tipo de Regime	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: DEPOSITADO e REGISTRADO.

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

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	Campo de preenchimento opcional. Caixa com as opções: Sim e Vazio. 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”
Código Identificador	Campo de preenchimento obrigatório, quando houver. Formato: texto com 20 posições
Variação Quanto	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. Campo para informar se a valorização do ativo subjacente será em real ou na moeda do ativo. <u>Se a opção selecionada for Sim:</u> Não será contabilizada a variação da moeda do ativo. <u>Se a opção selecionada for Não:</u> Será contabilizada a variação da moeda do ativo.
Data Inicial Paridade Não Quanto	Não preencher se o campo “Valor Inicial Paridade” estiver preenchido. 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”. Campo no formato DD/MM/AAAA. A data indicada deve ser dia útil do calendário nacional. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data Fixing Paridade Não Quanto	Campo de preenchimento obrigatório, quando a moeda for diferente de BRL. Se moeda igual a BRL, o campo não deverá ser preenchido. Campo no formato DD/MM/AAAA. A data indicada deve ser dia útil do calendário nacional. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Valor Inicial da Paridade	Campo de preenchimento obrigatório, quando o campo “Variação Quanto” for preenchido com a opção “Não”. Não preencher se o campo “Data Inicial Paridade Não Quanto” estiver preenchido. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. Valor inicial de conversão cambial para o ativo internacional. Formato: Numérico com 5 inteiros e 8 decimais.

Campo	Descrição
Entrega Física	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. Exclusivo para COE alienado pelo Emissor, para seu Cliente (1 ou 2). Caixa com as opções: vazio e Sim.
Descrição Entrega Física	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.
Pagamento Extraordinário	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. Atenção: Observar as condições permitidas para uso na função “Indicação de Pagamento Extraordinário”. Com os domínios: Branco, Sim – Final e Sim – Fluxo. • 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). A opção Sim - Fluxo, não pode ser utilizado para COE que não tenha Fluxo de Caixa.
Funcionalidade	Campo de preenchimento opcional. Com os domínios: Watermark Performance, Performance Acumulada Campo que indica as funcionalidades que podem ser adicionadas ao COE Para mais informações sobre as funcionalidades disponíveis, consultar a seção Funcionalidade.
Fluxo de Caixa	Campo de preenchimento obrigatório. Com os domínios: “Sim” e “Não”. Indica se o COE terá eventos intermediários. Quando indicado SIM, os dados específicos do fluxo serão informados na seção de Fluxo de Caixa.
Lookback	Campo de preenchimento opcional. Caixa com as opções: “Sim” e “Não”.

Campo	Descrição
Critério de Lookback	Campo de preenchimento obrigatório se Lookback igual a "SIM" e não deve ser preenchido se Lookback igual a "Não". Caixa com as opções: Máximo, Mínimo e VAZIO.
Data Inicial de Lookback	Campo de preenchimento obrigatório se Lookback igual a "SIM" e não deve ser preenchido se Lookback igual a "Não". O campo deve ser igual ou maior do que a data de Emissão do COE. Campo no formato DD/MM/AAAA.
Data Final de Lookback	Campo de preenchimento obrigatório se Lookback igual a "SIM". O campo deve ser igual ou menor do que D-1 da data de vencimento e maior ou igual a Data Inicial de Lookback. Campo no formato DD/MM/AAAA. 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 atualização de PU (atualização valores lookback).
Dados Específicos – COE001007 - Straddle (utilizado como exemplo da tela)	
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. Numero indicando a quantidade de opções que devem ser utilizadas no Strike 1. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
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.

Campo	Descrição
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
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. 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”. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para o Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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.

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:

Reaproveitar COE

Certificado Operações Estruturadas 'TH0115F74V2' Incluído com sucesso.

Prosseguir

Voltar

Desistir

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

Tela Parametrização de Cesta

Parametrização de Cesta

Manter Dados Cesta?

NÃO

Tipo de Cesta

STANDARD

Quantidade de Ativos na Cesta

2

Confirmar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

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,	
Enviar Limpar Campos Voltar 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	
Prosseguir Voltar 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
Confirmar Limpar Campos Voltar 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

20/8/2021

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

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
- Instrução CVM 569
- 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	
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										
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir										

Descrição dos campos da tela Registro de Fluxo de Caixa COE

Campo	Descrição
Condicionante de Barreira Cupom (%)	Preenchimento obrigatório se algum dos campos Barreira Cupom (%) do fluxo estiver preenchido. Caixa com as opções: Vazio, Acima, Abaixo e Entre. - 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	Campo de preenchimento obrigatório. Com os domínios: SEM REMUNERAÇÃO, PRE, DI, IPCA VCP, USD VCP, NO PERÍODO Indica o indexador para pagamento de juros exclusivamente nas datas de evento informadas. 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).
Base	Campo de preenchimento obrigatório, quando informado o campo Spread/Cupom (%). Com os domínios: 252 exp, 360 exp, 360 lin Indica a base de cálculo do cupom de juros do fluxo de caixa.

Campo	Descrição
Condicionante de Barreira Chamada (%)	Preenchimento obrigatório se algum dos campos Barreira Chamada (%) do fluxo estiver preenchido. Caixa com as opções: Vazio, Acima, Abaixo e Entre. - 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 (%)” 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 (%)”
Memória de Cupom	Caixa com as opções: SIM, NÃO 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.
Data	Campo de preenchimento obrigatório para todos os fluxos. 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. A última data do fluxo deve vir preenchida com a data de vencimento mas será passível de alteração. Campo no formato DD/MM/AAAA.
Remunerador (%)	Campo de preenchimento obrigatório se “Remunerador no fluxo” for igual a “DI” e opcional se igual a “IPCA VCP”. Não deve ser preenchido se “Remunerador no fluxo” for igual a “PRE” ou “NO PERIODO”. Campo no formato numérico, (%) percentual de 4 inteiros e 4 decimais. Aceita valores positivos e superiores a zero.
Spread/Cupom (%)	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”. Campo no formato numérico, (%) percentual de 5 inteiros e 4 decimais. Aceita valores positivos e zero.

Campo	Descrição
Barreira Cupom (%)	Campo de preenchimento obrigatório para pelo menos uma data do fluxo se o campo Condicionante de Barreira Cupom (%) estiver preenchido. 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.
Barreira Cupom 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório quando campo “Condicionante de Barreira de Cupom (%)” é igual a “ENTRE”. 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.
Barreira Chamada (%)	Campo de preenchimento obrigatório para pelo menos uma data do fluxo se o campo Condicionante de Barreira Chamada (%) estiver preenchido. 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.
Barreira Chamada 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório quando campo “Condicionante de Barreira de Chamada (%)” é igual a “ENTRE” 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.
Data Fixing	Campo de preenchimento obrigatório. 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>. Não pode ser superior à data do evento, menor do que a data de emissão ou de início do COE ou final de semana.
Data Fixing 2	Campo de preenchimento opcional. Se indicado, será obrigatório o preenchimento do campo “Tipo de Fixing” Indica a data final para formação do <i>fixing</i> do evento 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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing	Campo de preenchimento obrigatório quando o campo “Data Fixing 2” estiver preenchido. Campo com os domínios: Máximo no período, Média no período, Mínimo no período, Verificação data a data • 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. • 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 à 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	TH0713J04OU		
Conta Emissor	05000	.40	-7
Nome simplificado Emissor	RIOBM		
Confirmar Limpar Campos 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	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 ,
Data de Referência	23 / 10 / 2013
Enviar Limpar Campos Voltar 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

Confirmar

Corrigir

Voltar

Desistir

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

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)

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

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 	Código Parte 	Meu Número 	Código Contraparte
Número da Associação 			
Liquidação Financeira		Dados da Operação	
Liquidante 	Modalidade Bruta	Quantidade 	P.U.
Dados Complementares			
CPF/CNPJ (Cliente) 		Natureza (Cliente) 	
Enviar Limpar Campos Voltar 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		
Motivo		
Confirmar Limpar Campos 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
Liquidação Financeira		Dados da Operação	
Liquidante	Modalidade	Quantidade	Preço Unitário
	SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO		
Dados Complementares			
Reserva Técnica	Data op. Original	Número Oper. CETIP	
CPF/CNPJ (Cliente)	Natureza (Cliente)	Motivo	
		ORDEM JUDICIAL	
Posição Origem - Bloqueio Judicial	Num. Cetip Op. Original - Bloqueio Judicial		
Enviar Limpar Campos Voltar 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	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.
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, apresentado somente quando na tela de filtro o campo Motivo for igual a Ordem Judicial. 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.

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 	IF Inadimplente/Com Restrição ▼	Ciência da Liquidação Antecipada ▼
Parte		Contraparte	
Papel ▼	Código 	Meu Número 	Número da Associação
Código 		Código 	
Liquidação Financeira		Dados da Operação	
Liquidante 	Modalidade SEM MODALIDADE DE LIQUIDACAO ▼	Quantidade 	P.U.
Dados Complementares			
Reserva Técnica ▼	Data op.Original 	Número Oper. CETIP 	
CPF/CNPJ (Cliente) 	Natureza (Cliente) ▼	Posição Origem ▼	
Num. Cetip Op. Original - Bloqueio Judicial 	Data Liquidação 		
Enviar Limpar Campos 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 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 nº 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 		
Solicitante		Detentor	
Código 	Meu Número 	Código Detentor 	
Quantidade 	Protocolo da Ordem de Bloqueio 		
Tipo 	Tipo de Bloqueio 	Num. Cetip Op. Original 	
Número do Processo 	Vara 		
Motivo 			
Dados Complementares			
CPF/CNPJ (Cliente) 	Natureza (Cliente) 	Código cliente para operações por conta e ordem 	
Enviar Limpar Campos 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
Enviar Limpar Campos 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”.

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.

4. Deve ser usado quando o campo “Remunerador no vencimento” for preenchido com “IPCA VCP”, “IBOVESPA VCP” ou “USD VCP”. 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.

Deve ser usado para se atualizar o Valor Inicial do ativo-subjacente. A atualização desse valor, por esse motivo, só é possível em D+1 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. Remunardor 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

A tela exibe o caminho de navegação: Certificado de Operações Estruturadas > Lançamentos > Atualização de PU. O formulário principal, intitulado 'Atualização de PU de um COE', possui os seguintes campos:

- Conta Emissora:** Campos numéricos com os valores 05000, 40 e 7.
- Código IF:** Campo de texto com o valor TH0119H7VVJ.
- Tipo Atualização:** Menu suspenso com a opção selecionada 'Valor Inicial Ativo Subjacente'.

Na base do formulário, há três botões: 'Confirmar', 'Limpar Campos' e '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.
Código IF	Código Cetip do COE.

Campo	Descrição
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 / /	Valor Inicial do Ativo Subjacente ,
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir	

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.
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".

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 ,
Enviar Limpar Campos Voltar 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 	Fator de Juros
Fator de Correção de Remuneração 	
Enviar Limpar Campos Voltar 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 Remuneração	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 ,
Enviar Limpar Campos Voltar 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	Nome Simplificado do Emissor
05000.40-7	RIOBM
Código IF	Nome Fantasia
TH1515C6TTX	Teste1
Data de Emissão	Data de Vencimento
03/03/2015	06/03/2015
Data da Última Atualização PU	
03/03/2015	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização	Fator de Correção de Remuneração
5 / 3 / 2015	5 ,
Enviar Limpar Campos Voltar 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
Enviar Limpar Campos Voltar 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 ,
Enviar Limpar Campos Voltar 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 em D+1 ao dia do registro.
Valor Inicial do Ativo Subjacente	Novo valor inicial do ativo subjacente. Formato: 12 inteiros e 8 decimais.

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 / /	
Código do Ativo Subjacente BBAS3	Valor Inicial do Ativo Subjacente ,
Código do Ativo Subjacente ITUB4	Valor Inicial do Ativo Subjacente ,
Código do Ativo Subjacente CHUMBO	Valor Inicial do Ativo Subjacente ,
Enviar Limpar Campos Voltar 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 / /
Valor Inicial do Ativo Subjacente Lookback ,	
Enviar Limpar Campos Voltar 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 / /	Valor do Ativo Subjacente ,
Enviar Limpar Campos Voltar 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	Nome Simplificado do Emissor
05000.40-7	RIOBM
Código IF	Nome Fantasia
TH0118H7UPS	Teste
Data de Emissão	Data de Vencimento
31/08/2018	02/09/2019
Data da Última Atualização PU	
31/08/2018	
Dados para Lançamento	
Data da Atualização	Fator de Correção
Fator de Juros	
Enviar Limpar Campos Voltar 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	05000	40 7
Código IF	TH0914A2LEV	
Confirmar Limpar Campos Desistir		

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 × ,
Enviar Limpar Campos Voltar 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 COE	Código IF 	IF com restrição 	
Parte			Contraparte
Papel 	Código 	Meu Número 	Código
Dados da Operação de Garantia			
Quantidade 	Direitos p/ Garantidor 	Tipo de Garantia 	
Dados Complementares			
CPF/CNPJ (Cliente) 		Natureza (Cliente) 	
Enviar Limpar Campos 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	Informa se o instrumento financeiro a ser vinculado em conta garantia está inadimplente ou não. Caixa de seleção com as opções: Sim ou em branco.
Parte e Contraparte – Campos de preenchimento obrigatório.	
Papel	Indicar o Participante que está lançando a operação. Caixa de seleção com as opções: Garantidor e Garantido
Código	Código Cetip (conta 60) do Garantidor ou do Garantido.
Meu número	Número desta operação. Não é obrigatório que Parte e Contraparte informem o mesmo número.
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	Caixa de seleção com as opções: Sim ou Não. Indica se os créditos referentes aos títulos dados em garantia na ocorrência de eventos são atribuídos ao Garantidor. Caso a opção escolhida seja Não, os créditos são atribuídos ao Garantido.
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	
Instrumento Financeiro	
Contraparte	
Num. Cetip Op. Original	
Meu número	
Data op. original	
Enviar Limpar Campos 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
Todos os campos são de preenchimento obrigatório.	
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
TH0115E6Z8O	08/05/2015
Conta Emissora	Nome Simplificado do Emissor
05000.40-7	RIOBM
Dados para Lançamento	
Valor do PU para Entrega Física	,
Valor do PU para Resgate	,
Enviar Limpar Campos Voltar 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 BVM&FBovespa.

Tela Manutenção de Código ISIN

Manutenção de Código ISIN	
Instrumento Financeiro	
Tipo	COE
Código IF	TH0115F74VS
Código ISIN	BRAAAABBBM6
Enviar Limpar Campos 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			
Confirmar Corrigir 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

Parametrização de Cesta

Código IF: SH0115E6ZH5

Manter Dados Cesta?: [dropdown]

Tipo de Cesta: WORST OF

Quantidade de Ativos na Cesta: 1

Ação: INCLUIR

Botões: Confirmar, Limpar Campos, Desistir

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

Tela Parametrização de Cesta - WORST OF ou BEST OF

Parametrização de Cesta

Ação
 INCLUIR

Tipo de Cesta
 WORST OF

Moeda paridade
 REAL

Valor inicial paridade
 ,

Data Fixing Paridade
 / /

Código do Ativo Subjacente
 ,

Tipo Cotação para Liquidação
 FECHAMENTO

Valor Inicial do Ativo Subjacente
 ,

Data Fixing
 / /

Código do Ativo Subjacente
 ,

Tipo Cotação para Liquidação
 FECHAMENTO

Valor Inicial do Ativo Subjacente
 ,

Data Fixing
 / /

Código do Ativo Subjacente
 ,

Tipo Cotação para Liquidação
 FECHAMENTO

Valor Inicial do Ativo Subjacente
 ,

Data Fixing
 / /

Código do Ativo Subjacente
 ,

Tipo Cotação para Liquidação
 FECHAMENTO

Valor Inicial do Ativo Subjacente
 ,

Data Fixing
 / /

Enviar Limpar Campos Voltar Desistir

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

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

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		
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 ,	
Enviar Limpar Campos Voltar Desistir					

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

Campo	Descrição
	Campo de preenchimento obrigatório.
	Caixa com as opções: REAL, EURO/COM. EUROPEIA, LIBRA ESTERLINA, IENE E DOLAR DOS EUA.
Moeda paridade	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. Para opção QUANTO “SIM”, somente REAL pode ser escolhido.
Valor inicial paridade	Campo de preenchimento obrigatório se moeda diferente de REAL. Não preencher se moeda igual a REAL. Valor inicial de referência para o cálculo da variação da paridade da cesta. Campo no formato numérico com 5 inteiros e 8 decimais.
Data Fixing Paridade	Campo de preenchimento obrigatório se moeda diferente de REAL. Não preencher se moeda igual a REAL. Data de referência para a captura do valor final de cada ativo subjacente que compõe a cesta. Campo no formato DD/MM/AAAA.
Código do Ativo Subjacente	Campo de preenchimento obrigatório. Somente os ativos subjacentes disponíveis na Consulta de Ativos Subjacentes podem ser utilizados para compor cestas.

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 DOLAR DOS EUA	Valor inicial paridade 3,07000000	Data Fixing Paridade 25/06/2015		
Código do Ativo Subjacente COBRE	Tipo Cotação para Liquidação FECHAMENTO	Valor Inicial do Ativo Subjacente 13,00000000	Data Fixing 25/06/2015	Peso % 50,0000
Código do Ativo Subjacente CHUMBO	Tipo Cotação para Liquidação FECHAMENTO	Valor Inicial do Ativo Subjacente 12,00000000	Data Fixing 25/06/2015	Peso % 50,0000
Confirmar Corrigir Voltar Desistir				

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

00684

40

2

Código IF

MO0115L7DWE

Confirmar

Limpar Campos

Desistir

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	Data de Vencimento
MO0115L7DWE	22/12/2015
Conta Emissora	Nome Simplificado do Emissor
00684.40-2	MOOCABM
Dados para Lançamento	
Fator Evento Extraordinário 1,05900000	
Confirmar Corrigir Voltar Desistir	

Descrição dos campos da Tela Lançamento de Pagamento Extraordinário

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

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	12345	40	7
Código IF	TESTE011232		
Ação	INCLUIR ▼		
Manter Fluxo Atual?	▼		
Número de Datas	3		

ConfirmarLimpar CamposDesistir

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

Enviar

Limpar Campos

Voltar

Desistir

Campo	Descrição
	Campo de preenchimento obrigatório.
Data Fixing	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		TERÇA-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			
Confirmar Corrigir 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 COE	Código IF TH0115K7DB1			
Parte			Contraparte	
Papel DETENTOR	Código 54545	Meu Número 70	Código 54545	
			97	5
Dados da Operação				
Quantidade 1				
Dados Complementares				
Data op. original 24/11/2015			Num. Cetip Op. Original 2015112412660190	
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.
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
				BRANCOSEG
Papel	RESERVA TECNICA	Código	54545.97-5	Nome Simplificado
				BRANCOSEG
Orgão Regulador	27909.00-5		SUSEP	
Quantidade	1			Meu Número 7
Confirmar Corrigir 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

TH3013H008J

Nome Figura

SELECIONE

Conta Emissor

Nome simplificado Emissor

Confirmar

Limpar Campos

Desistir

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

Atualizar

Voltar

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: SELECIONE ▼

Código IF:

Tipo de Regime: ▼

Conta Emissora:

Conta Detentora:

Classe do Ativo Subjacente: SELECIONE ▼

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 é 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

« 1 »

Excel ▼

(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)

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
	106.23		CONFIRMADO							Não	REGISTRADO

(fim)

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

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

[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

(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 AÇÕES ▼

Confirmar
Limpar Campos
Desistir

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

Atualizar

Voltar

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: Excel

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

Confirmar
Limpar Campos
Desistir

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
Exibir página
>>

Obter no formato:
Excel

Atualizar
Voltar

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									
Voltar 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
MO3414D4T1Z	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 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	RIOBM
Conta Emissora	
Código IF	
Tipo de COE	SELECIONE ▼
Confirmar Limpar Campos 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 Atualizar Voltar Obter no formato: 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 05000 .40 7
 Código IF TH0120H7Z5H

Pesquisar Limpar Campos Desistir

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

i Critério de pesquisa

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.

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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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 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.
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	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". 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.
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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.

Campo	Descrição
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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 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.

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.
Rebate no Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.
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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". 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.
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 Pagamento	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: Ato e Vencimento. 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.
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.

Campo	Descrição
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Americana”. 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. Formato: DD/MM/AAAA.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.

Campo	Descrição
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.
Barreira no Cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.
Rebate no Cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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 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”.

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". 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.
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 Pagamento	Campo de preenchimento obrigatório. 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. Se indicado "Vencimento" e houver disparo do trigger, o contrato será marcado sendo o pagamento efetuado apenas no vencimento.
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.

Campo	Descrição
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 à 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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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 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.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". 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.
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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.

Campo	Descrição
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.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
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
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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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.

Campo	Descrição
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.
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.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.

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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for selecionado "Janela de Datas" ou "Mais Datas" . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. - 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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.
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.
Barreira no Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
Rebate no Cenário de Alta (%)	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, sempre maior que zero.
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.

Campo	Descrição
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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
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
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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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.

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	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, sempre maior que zero.
Rebate no Cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for menor ou igual a barreira no período de verificação. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, sempre maior que zero.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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.
Participação cenário de alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Número indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.

Campo	Descrição
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
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.

Campo	Descrição
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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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.

Campo	Descrição
Barreira no cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente.
Rebate no Cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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.
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.
Barreira Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.

Campo	Descrição
Rebate no Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE quando detectado que a cotação for maior que a barreira no período de verificação.
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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.

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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.

Campo	Descrição
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
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.

Campo	Descrição
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”, 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”. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. • 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 (%)	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 menor que strike 2.
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.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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 menor que strike 2.
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.

Campo	Descrição
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.
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2 Formato: Número com 8 inteiros e 8 decimais.
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.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	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.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré e DI.

Campo	Descrição
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. Para o indicador “Pré”, 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”. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”
Tipo de Cotação para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
Barreira Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
Barreira no Cenário de Baixa (%)	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, sempre maior que zero.
Dados Específicos – COE001016 - Strangle	
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 e menor que strike 2.
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.

Campo	Descrição
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.
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.
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.
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.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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 menor que strike 2.
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.

Campo	Descrição
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.
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.
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.
Barreira Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
Rebate no Cenário de Alta (%)	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, sempre maior que zero.
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.

Campo	Descrição
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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
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
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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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 menor que strike 2.
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.

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	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, sempre maior que zero.
Rebate no Cenário de Baixa (%)	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, sempre maior que zero.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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.
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.
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.
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.

Campo	Descrição
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".

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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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 menor que strike 2.
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.

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	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, sempre maior que zero.
Rebate no Cenário de Baixa (%)	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, sempre maior que zero.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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.
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.
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.
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.
Barreira Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.

Campo	Descrição
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado 'Sim', em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.
Rebate no Cenário de Alta (%)	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, sempre maior que zero.
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 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".

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
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.

Campo	Descrição
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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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, sempre maior que zero.

Campo	Descrição
Barreira Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
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.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré e DI.
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. Para o indicador “Pré”, 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”. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.
Tipo de Cotação para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.

Campo	Descrição
Fator barreira móvel superior	Campo de preenchimento obrigatório. Fator que deve ser somado diariamente da barreira superior. Formato: Numérico com 5 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.
Fator barreira móvel inferior	Campo de preenchimento obrigatório. Fator que deve ser subtraído diariamente da barreira inferior. Formato: Numérico com 5 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.
Dados Específicos – COE001021 - Call KI	
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.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

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".
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.
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".
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.
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.

Campo	Descrição
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.
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.
Barreira KI	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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.

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
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
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.
Barreira KI	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
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.
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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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 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.

Campo	Descrição
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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
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
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.
Barreira KI	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
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.
Barreira KO	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Indica a barreira de KO da estrutura. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Rebate KO (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
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.

Campo	Descrição
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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
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.
Barreira KI	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
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.
Barreira KO	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Indica a barreira de KO da estrutura. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.

Campo	Descrição
Rebate KO (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	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.
---	---

Campo	Descrição
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.
Barreira superior (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e maior que Barreira inferior.
Barreira inferior (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e menor que Barreira superior.
Data Inicial para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. 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. 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.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré, DI e NO PERÍODO.
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. Para o indicador “Pré”, este campo não deverá ser preenchido. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.

Campo	Descrição
Cupom Remunerador Adicional	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Pré”. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”
Dados Específicos – COE001026 - One Touch	
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.
Direção barreira	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a forma de rompimento da barreira que será atingida. Campo com as opções: Acima e Abaixo,
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.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré, DI e NO PERÍODO.
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. Para o indicador “Pré”, 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”. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
Dados Específicos – COE001027 - Condor	
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 e menor que strike 2.
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”.
Strike 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e maior que strike 1. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.

Campo	Descrição
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”.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for selecionado "Janela de Datas" ou "Mais Datas" . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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.

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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.
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.
Barreira Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.
Rebate no Cenário de Alta (%)	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, sempre maior que zero.

Campo	Descrição
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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
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
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.
Barreira KIKO	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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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.

Campo	Descrição
Barreira no Cenário de Baixa (%)	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, sempre maior que zero.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	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.
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.
Barreira Cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo.
Opções Dependentes	Campo de preenchimento obrigatório Caso selecionado ‘Sim’, em um eventual atingimento de barreira de Knock-out, as opções da estrutura serão desmontadas juntas. 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. Campo com as opções: Sim e Não.

Campo	Descrição
Rebate no Cenário de Alta (%)	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, sempre maior que zero.
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 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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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.
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.
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.

Campo	Descrição
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	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.

Campo	Descrição
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.
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 inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
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
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.
Vértice de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, menor ou igual ao Strike 1.
Vértice de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual ao Strike 1.
Participação cenário de alta 2 (%)	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 2 (%)	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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 – COE001033 – Participation Forward Limitadores

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 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.

Campo	Descrição
	Campo de preenchimento obrigatório.
Limitador cenário de alta (%)	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 de preenchimento obrigatório.
Participação cenário de baixa (%)	Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
	Campo de preenchimento obrigatório.
Limitador cenário de baixa (%)	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”.
	Campo de preenchimento obrigatório.
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	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”.
	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Data única". Formato: DD/MM/AAAA.
Data para fixing	Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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 inicial para fixing	Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. 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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, menor ou igual ao Strike 1.
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.

Campo	Descrição
Vértice de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual ao 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 alta 2 (%)	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.
Participação cenário de baixa 2 (%)	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	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. 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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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(%)	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 menor que strike 2.
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.
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.

Campo	Descrição
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a quantidade do ativo subjacente que é utilizado no cálculo de ajuste referente ao Strike 2. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.
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 "Strike 2 (%)".
Remuneração abaixo (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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.
Remuneração acima (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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.
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	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. 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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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(%)	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 menor que strike 2.
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.

Campo	Descrição
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”.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”.

Campo	Descrição
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.
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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "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. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA".
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". 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. 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.
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.
Barreira KI	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.

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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	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.
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.

Campo	Descrição
Barreira superior (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e maior que Barreira inferior.
Barreira inferior (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0 e menor que Barreira superior.
Data Inicial para Verificação	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” Formato: DD/MM/AAAA.
Data Final para Verificação	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. Formato: DD/MM/AAAA.
Remuneração Adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o tipo de remunerador que será utilizado. Campo com as opções: Pré, DI e No Período.
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. Para o indicador “Pré”, 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”. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais, incluindo o sinal “-“ e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”

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	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 1 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).
----------------------------	---

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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Numero indicando percentual a ser aplicado sobre a desvalorização do Ativo Subjacente 2.
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.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. 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 indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. 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.
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 1. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Tipo de cotação para liquidação 2	Campo de preenchimento obrigatório. Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 2. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 1 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).
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.

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	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.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. 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 indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. 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.
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 1. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste
Tipo de Cotação para Liquidação 2	Campo de preenchimento obrigatório. Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 2. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a quantidade de camadas no contrato. Campo com as opções: 2 ou 3
Strike 1(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
Strike 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, deve ser maior que strike 1 e maior que zero. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.

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

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

Campo	Descrição
Data inicial para fixing	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. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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 somente se indicado “Europeia” no campo “Período de Verificação de barreiras”, e for utilizada uma janela de datas para formação do fixing. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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.
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 o tipo de cotação a ser considerada como fixing para a liquidação da operação. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Período de Verificação de barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se a verificação das barreiras será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia).
Data Inicial para verificação	Campo de preenchimento obrigatório somente se indicado “Americana” no campo “Período de Verificação de barreiras”. Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”

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(%)	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 2	Campo de preenchimento obrigatório. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.
Participação cenário de Alta 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente.
Barreira no cenário de Alta 2 (%)	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 2(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de alta seja atingida.
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras.
Tipo de Cotação para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na liquidação da operação.

Campo	Descrição
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 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.
Período de verificação de barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se a verificação das barreiras será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia).
Data Inicial para verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana. Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”

Campo	Descrição
Data final para verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, e inferior a data de vencimento.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 001043 – Edge Accrual	
Data inicial para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”

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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
Tipo de Cotação para Liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. 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, PRÉ 252, DI, e NO PERIODO.
Remunerador Flutuante Adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “DI”. 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.
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 deve ser considerada como “+”
Barreira de Baixa (%)	Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do ativo subjacente. Deverá ser preenchido com valor menor ao que o indicado no campo Strike 1 (%). Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0 e igual ou inferior a 100.

Campo	Descrição
Cupom barreira de baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se preenchido o campo “Barreira de Baixa (%)”. 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. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais. Deve ser diferente de 0.
Quantidade mínima de ativos acima do Strike	Campo de preenchimento obrigatório. 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. Formato: Numérico com 2 inteiros, maior ou igual a 1 e inferior à quantidade de ativos da cesta.
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.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. A partir de D+1 da “Data de Emissão” e menor que “Data Final para Fixing”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. 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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo "Período de captura do ativo subjacente para liquidação" for selecionado "Janela de Datas" ou "Mais Datas" . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. • 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	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções para o Ativo Subjacente 1 (Pré, DI ou IPCA).
Participação Indexador 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 1” indicado como “DI” ou “IPCA”. 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 (%)”. Para “Pré”, este campo não deverá ser preenchido. Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Cupom Período 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 1” indicado como “Pré”. Preenchimento opcional se indicado como “DI” ou “IPCA”. Se “Ativo Subjacente 2” também tiver sido indicado como “Pré”, este campo deve ser preenchido com um percentual diferente de “Cupom Período 2 (%)”. Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.
Base Período 1	Campo de preenchimento obrigatório quando informado o campo Cupom Período 1 (%). Campo indicador para informar a base do Cupom do Período 1. Campo com as opções: 252 exp, 360 exp e 360 lin.
Ativo Subjacente Período 2	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções para o Ativo Subjacente 2 (Pré, ou DI ou IPCA).
Participação Indexador 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 2” indicado como “DI” ou “IPCA”. 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 1 (%)”. Para “Pré”, este campo não deverá ser preenchido. Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, maior que 0.

Campo	Descrição
Cupom Período 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório se “Ativo Subjacente 2” indicado como “Pré”. Preenchimento opcional se indicado como “DI” ou “IPCA”. Se “Ativo Subjacente 1” também tiver sido indicado como “Pré”, este campo deve ser preenchido com um percentual diferente de “Cupom Período 1 (%)”. Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais, incluindo o sinal “-” e “+”. A não indicação do sinal deve ser considerada como “+”.
Base Período 2	Campo de preenchimento obrigatório, quando informado o campo Cupom Período 2 (%). Campo indicador para informar a base do Cupom do Período 2. Campo com as opções: 252 exp, 360 exp e 360 lin.
Data da troca do ativo subjacente	Campo de preenchimento obrigatório. 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 Formato: DD/MM/AAAA.
Dados específicos - Figura COE001046 – CallSpread + Call KO	
Strike 1(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Strike do Callspread. 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 10 inteiros e 8 decimais.
Participação cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente para o Callspread.

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

Campo	Descrição
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 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”.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado “Janela de datas”. Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. A partir de D+1 da “Data de Emissão” (ou “Emissão a Termo”), e menor que “Data Final para Fixing”.

Campo	Descrição
Data final para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a "Classe do Ativo Subjacente" for igual a "CESTA". 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.
Período de verificação de barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se a verificação das barreiras será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia).
Data Inicial para verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a "data final de verificação."
Data final para verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Esta data deve ser superior à indicada no campo "Data Inicial para verificação", e inferior a data de vencimento.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. O Strike indicado deverá ser maior que zero.
Quantidade 1	Campo de preenchimento obrigatório. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.

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

2 - Dados CCall KO (Up and Out)

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

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

Participação cenário de Alta 2 (%)	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 no cenário de Alta 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. A barreira de KO2 indicada deverá ser igual a barreira de KO3. O Número indicado deverá ser maior que zero.
Rebate no Cenário de Alta 2(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de alta seja atingida.
3 – Dados VPut KO (Up and Out)	
Strike 3 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. O Strike indicado deverá ser menor/igual que os Strikes 1 e 2. O Strike indicado deverá ser maior que zero.
Quantidade 3	Campo de preenchimento obrigatório. A quantidade indicada deverá ser maior que zero.
Participação cenário de Baixa 3 (%)	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 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	Campo de preenchimento obrigatório. Campo percentual aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente indicando a barreira de KI da estrutura. A barreira de KI não deverá ser menor que o Strike 4.
Rebate KI 4(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o VFE caso a cotação do ativo não atinja a barreira de Knock-in.
Tipo de Cotação para verificação de barreiras cenário de alta	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras.
Período de verificação de barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se a verificação da barreira será diária (americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (europeia). A indicação será válida para todas as barreiras da estrutura (KO1,KO2 e KI).
Data Inicial para verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana. Data inicial da janela de verificação. Deve ser superior a data de emissão e inferior a “data final de verificação.”

Campo	Descrição
Data final para verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o período de verificação de barreiras for americana. Esta data deve ser superior a indicada no campo “Data Inicial para verificação”, 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.
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 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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. O Strike indicado deverá ser maior que zero.
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”.

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	Campo de preenchimento obrigatório. Indica a forma de rompimento da barreira que será atingida. Campo com as opções: Acima e Abaixo. Se “ACIMA”: a barreira é atingida caso a cotação do ativo seja maior ou igual à barreira. Se “ABAIXO”: a barreira é atingida caso a cotação do ativo seja menor ou igual à barreira.
Data Inicial para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. 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. 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.
Tipo de Cotação para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. Tipo de cotação do ativo subjacente 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.
Rebate KO(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero. 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.

Campo	Descrição
Período de Pagamento	Campo de preenchimento obrigatório. 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.
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	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 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 1 (ativo subjacente da Call KO). Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste

Campo	Descrição
Tipo de Cotação para Liquidação 2	Campo de preenchimento obrigatório. Indicação de qual será a cotação a ser considerada na liquidação da operação, referente ao Ativo Subjacente 2 (ativo subjacente da Put). Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
1- Informações referentes a Call KO	
Classe do ativo subjacente 1	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções das Classes de Ativos referente ao Ativo Subjacente 1 (TAXAS DE CAMBIO, INDICES).
Ativo Subjacente 1	Campo de preenchimento obrigatório. Ativo subjacente da Call KO. Campo com as opções IBOVESPA e DOLAR DOS EUA.
Valor Inicial Ativo Subjacente 1	Campo de preenchimento obrigatório. Valor inicial do Ativo Subjacente 1. Esse valor serve de referência para o cálculo do strike e da barreira de KO da Call KO. Formato: numérico, 10 inteiros e 4 decimais.
Strike 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar o strike da Call KO, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Quantidade 1	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a quantidade do Ativo Subjacente 1. A quantidade indicada deverá ser maior que zero. Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.
Barreira cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a barreira de knock out da Call KO, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.

Campo	Descrição
Participação cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente 1. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Rebate KO(%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de knock out seja atingida no período de verificação. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na verificação da barreira de knock out. 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. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (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, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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” Formato: DD/MM/AAAA
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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. Formato: DD/MM/AAAA.

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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	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. Formato: DD/MM/AAAA.
Data Final de Lookback	Nesta figura, este campo é de preenchimento obrigatório. Deverá ser registrado com a última data de verificação de Lookback. 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). Formato: DD/MM/AAAA.
Dados Específicos da figura	
Strike 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Formato: Numérico percentual com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente.
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 alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Número indicando percentual a ser aplicado sobre a valorização do ativo subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior que 0

Campo	Descrição
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”.
Data inicial para fixing	Campo de preenchimento obrigatório, se indicado "Janela de datas". Formato: DD/MM/AAAA. Não preencher se a “Classe do Ativo Subjacente” for igual a “CESTA”. 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” 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	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.
Data de Observação 1	Campo de preenchimento obrigatório. Informa a 1ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.
Data de Observação 2	Campo de preenchimento opcional. Informa a 2ª data da cotação que será considerada para apuração do lookback. Formato: DD/MM/AAAA.

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	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 001051 – Call Spread KI + Put

Informações referentes a Call Spread KI + Put

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

Campo	Descrição
Quantidade 2	Campo de preenchimento opcional. Informar a quantidade de Put. A quantidade indicada deverá ser maior que zero. Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.
Participação cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento opcional. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Participação cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento opcional. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Limitador cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, deverá ser maior que o Strike (%) e maior que 0.
Barreira KI (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a barreira de <i>knock in</i> da Call Spread KI, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
Rebate KI (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na verificação da barreira de <i>knock in</i>. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.

Campo	Descrição
Período de verificação de barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. 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). 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, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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” Formato: DD/MM/AAAA
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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. Formato: DD/MM/AAAA.
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 campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for preenchido com “Data única”. Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
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	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

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Quantidade 1	Campo de preenchimento opcional. Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero. Formato: Numérico com 10 inteiros e 4 decimais.
Participação cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.

Campo	Descrição
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.
Limitador Cenário de Baixa (%)	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.
Barreira KIKO	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a barreira de KIKO, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
Tipo de Cotação para Verificação de Barreiras no Cenário de Baixa	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na verificação da barreira de KIKO. 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. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (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, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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” Formato: DD/MM/AAAA

Campo	Descrição
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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. Formato: DD/MM/AAAA.
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 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

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	Campo de preenchimento opcional. Informar se haverá deslocamento no cálculo do accrual do DI, em relação a data de fluxo do COE* Campo com as opções de D-1 a D-30 *: Para mais informações sobre o cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas – COE.
-------------------------------	---

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

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	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.

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
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 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	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras de KI. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Data Inicial para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. 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” Formato: DD/MM/AAAA
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório. 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. Formato: DD/MM/AAAA.
Dados referente ao remunerador (Pré) da alocação – O percentual da alocação inicial é 100% obrigatoriamente	
Cupom remunerador adicional (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar o cupom da taxa Pré em % a.a. Formato: Numérico com 10 inteiros e 8 decimais.
Base remunerador adicional	Campo de preenchimento obrigatório. Campo com as opções: 252 EXP; 360 EXP; 360 LIN.
Dados referente ao Forward KI 1	
Strike_KI 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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. Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i>. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero.
Quantidade 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 1 Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.

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

Dados referente ao Forward KI 2

	Campo de preenchimento obrigatório, se houver.
	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.
Strike_KI 2	Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i> . Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero e menor que o Strike_KI 1
	Campo de preenchimento obrigatório, se houver.
Quantidade 2 (%)	Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 2 Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.

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

Dados referente ao Forward KI 3

	Campo de preenchimento obrigatório, se houver.
	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.
Strike_KI 3	Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i> . Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero e menor que o Strike_KI 2

Campo	Descrição
Quantidade 3 (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 3 Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.
Alocação 3 (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Informar a alocação do Nível 3 (em % do volume financeiro de emissão). Percentual do notional que será remunerado pela taxa Pré no Nível 3. A Alocação 3 deverá ser igual a: $(100\% - Q1 - Q2 - Q3)$ Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.
Dados referente ao Forward KI 4	
Strike_KI 4	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. 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. Para essa figura o Strike é sempre igual à barreira de <i>Knock In</i>. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que zero e menor que o Strike_KI 3
Quantidade 4 (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Informar a quantidade (em % do volume financeiro de emissão) da FWD KI 4 Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.
Alocação 4 (%)	Campo de preenchimento obrigatório, se houver. Informar a alocação do Nível 4 (em % do volume financeiro de emissão). Percentual do notional que será remunerado pela taxa Pré no Nível 4. A Alocação 4 deverá ser igual a: $(100\% - Q1 - Q2 - Q3 - Q4)$ Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais.
Dados referente ao Forward KI 5	

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

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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 001055 – CCallsSpread + VPutSpread + VPut

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

Campo	Descrição
Participação cenário de Alta (%)	Campo de preenchimento obrigatório. 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.
Limitador Cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre o valor inicial do Ativo Subjacente. Limitador da PutSpread. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Participação cenário de Baixa (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da PutSpread. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Participação cenário de baixa 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da Put. Formato: Numérico com 6 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 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	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
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. • 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 001056 – Double Call KO + CallSpread

Campo	Descrição
-------	-----------

Campo	Descrição
Strike 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar o strike, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: Numérico com 4 inteiros e 8 decimais, maior que 0.
Quantidade 1	Campo de preenchimento opcional. Informar a quantidade do Ativo Subjacente. A quantidade indicada deverá ser maior que zero. Formato: Numérico com 8 inteiros e 8 decimais.
Informações referente a Call KO1	
Participação cenário de Alta 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da Call KO1. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Barreira no cenário de Alta 1 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a barreira de knock out da Call KO1, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1. Deverá ser maior que o Strike e menor que a barreira de KO2. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
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 KO1 seja atingida no período de verificação. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.
Informações referentes a Call KO2	
Participação cenário de Alta 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica o percentual a ser aplicado sobre a valorização do Ativo Subjacente. Participação da Call KO2. Formato: Numérico com 6 inteiros e 4 decimais, maior que 0.
Barreira no cenário de alta 2 (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a barreira de knock out da Call KO2, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente 1. Deverá ser maior que a barreira de KO1 e menor que o Limitador. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.

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	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
Tipo de Cotação para verificação de barreira cenário de alta	Campo de preenchimento obrigatório. Tipo de cotação a ser considerada na verificação das barreiras de knock out. 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. Indica se a verificação da barreira será diária (Americana), dentro da janela de verificação, ou apenas no vencimento (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, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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” Formato: DD/MM/AAAA
Data final para verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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. Formato: DD/MM/AAAA.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas” . Campo com os domínios: Máxima no Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. 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	Campo de preenchimento opcional. Informar se haverá deslocamento no cálculo do <i>accrual</i> do DI, em relação a data de vencimento do COE* Campo com as opções de D-1 a D-30 *: Para mais informações sobre o cálculo, consultar o Caderno de Fórmulas – COE.

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

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

Campo	Descrição
Spread/Cupom (%)	Campo de preenchimento obrigatório se o Remunerador indicado for Pré ou No Período. Campo de preenchimento obrigatório, quando houver, se o Remunerador indicado for DI, IPCA VCP ou USD VCP. Formato: Numérico com 5 inteiros e 4 decimais.
Base	Campo de preenchimento obrigatório quando informado o campo Spread/Cupom (%). Não preencher se remunerador indicado for “No Período”. Campo para informar a base do cupom do Remunerador. Campo com as opções: 252 exp, 360 exp e 360 lin.
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.

Campo	Descrição						
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.						
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> *: Os domínios são criados sob demanda do Emissor.	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.						
Entrega Física	Campo habilitado quando a classe do ativo for Títulos Privados. Quando for Títulos Públicos, o campo não será habilitado. IMPORTANTE: nesta figura não haverá possibilidade de entrega física, portanto o campo deve ficar com preenchimento “vazio”.						
Fluxo de Caixa	Caixa com as opções: “Sim” e “Não”. Indica se haverá pagamento de juros intermediários. IMPORTANTE: nesta figura não haverá possibilidade de Indicar Fluxo de Caixa. Portanto o campo deve ficar com preenchimento “Não”.						

Campo	Descrição
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, o que é o caso dessa figura.

Dados específicos – Figura COE 001058 – Put KI + Callspread

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

Campo	Descrição
Barreira KI (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Informar a barreira de knock in da Put, em percentual. Percentual aplicado sobre o Valor Inicial do Ativo Subjacente. Formato: numérico com 4 inteiros e 8 decimais, sempre maior que zero.
Rebate KI (%)	Campo de preenchimento obrigatório. Indica percentual a ser aplicado sobre o Valor Financeiro de Emissão caso a barreira de knock in não seja atingida no período de verificação. Formato: numérico com 4 inteiros e 4 decimais, maior ou igual a zero.
Período de verificação de barreiras	Campo de preenchimento obrigatório. 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). 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, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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” Formato: DD/MM/AAAA
Data Final para Verificação	Campo de preenchimento obrigatório, caso o campo “Período de verificação de barreiras” for preenchido com “Americana”. 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. Formato: DD/MM/AAAA.
Período de captura do ativo subjacente para liquidação	Campo de preenchimento obrigatório. Indica se no fechamento da operação, os ativos subjacentes serão liquidados por uma data única ou pela média asiática de um período de datas. Campo com as opções: Data Única e Janela de 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.

Campo	Descrição
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	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”. Campo com as opções: Fechamento, Média, Máximo, Mínimo e Ajuste.
Tipo de cotação para verificação de barreira cenário de baixa	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.
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.

Campo	Descrição
Tipo de Fixing para Vencimento	Campo de preenchimento obrigatório quando no campo “Período de captura do ativo subjacente para liquidação” for selecionado “Janela de Datas” ou “Mais Datas”. Campo com os domínios: Máxima Período, Mínima no Período e Média no Período Indica como será formado o fixing para o vencimento do COE. • 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.

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 **pior** 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 podem ser positivos ou negativos 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 podem ser positivos ou negativos 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 podem 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 – Seção de Funcionalidades.