

LAYOUT EM IMPLEMENTAÇÃO

ATUALIZAÇÃO DE PU – REGISTRO DO COE

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES.....	3
2 ENVIAR ARQUIVOS:	4
2.1 Atualização PU – Registro do COE.....	4

1 ATUALIZAÇÕES

Atualizado em	Referência	Atualização
25/03/2021	Enviar Arquivos	Disponibilização do layout, conforme divulgado no Comunicado Externo 010/2021-VPC

Legendas:

➤ Novo campo.

2 ENVIAR ARQUIVOS:

COE – Certificado de Operações Estruturadas	
Nome do Arquivo	Tamanho do Registro: 190 caracteres
2.1 Atualização PU – Registro do COE	
<p>Descrição: Arquivo a ser utilizado para Lançamento de:</p> <p>1 - Valor Inicial Ativo Subjacente (Registro à Termo e Proteção contra Proventos quando estiver registrado a opção "Sim - Ajustado pelo Emissor");</p> <p>2 - PU para COE simplificado;</p> <p>3 - Remunerador (Quando o Remunerador for IPCA VCP ou IBOVESPA VCP ou USD VCP) ou Fator Correção Remunerador e Fator Juros Remunerador (Fluxo de Caixa com Remunerador IPCA VCP ou Fluxo de Caixa COE Simplificado);</p> <p>4 - Cotação para Fixing (Ativo Subjacente que não tem Cotação na Data de Fixing);</p> <p>5 - PU para Knock-out no ATO;</p> <p>6 - Fator Path Dependent;</p> <p>7 - Valor Ativo Subjacente Fluxo de Caixa;</p> <p>8 - Valor de Referência; e</p> <p>9 - Valores Lookback.</p> <p>10- Remunerador no Fluxo</p> <p>Estrutura: Header e Registro – Dados Fixos</p>	

Header					
Seq.	Nome do campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
01	Id do sistema	X(5)	1 a 5	COE	Tipo do Instrumento Financeiro
02	Id tipo linha	X(1)	6 a 6	0	Tipo de linha Header = 0
03	Código operação	X(4)	7 a 10	0810	Código da operação: 0810 - Atualização de COE
04	Participante	X(20)	11 a 30		Nome Simplificado do Emissor
05	Data	X(8)	31 a 38		Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

Registro – Dados Fixos					
Seq.	Nome do campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
01	Id do sistema	X(5)	1 a 5	COE	Tipo do Sistema
02	Id tipo linha	X(1)	6 a 6	1	Tipo de registro
03	Código operação	X(4)	7 a 10	0810	Código da operação de Atualização de COE
04	Código COE	X(11)	11 a 21	Obrigatório	Código COE. Formato MMFFAAMSSSS
05	Conta Emissor	X(10)	22 a 31	Obrigatório	Formato XXXXX.40-Y
06	Tipo Atualização	X(2)	32 a 33	Obrigatório	1 - Valor Inicial Ativo Subjacente 2 - PU para COE simplificado 3 - Remunerador no Vencimento 4 - Cotação para Fixing 5 - PU para Knock-out no ATO 6 - Fator Path Dependent 7 - Valor Ativo Subjacente para Fluxo de Caixa 8 - Valor de Referência 9 - Valores Lookback 10 - Remunerador no Fluxo
07	DataAtualizacaoPU	X(8)	34 a 41		Data de atualização do PU. AAAAMMDD
08	ValorPU	9(12),9(8)	42 a 61		Valor do PU - COE não calculado, para o tipo PU para COE simplificado e COE calculado com knock-out com pagamento no ato para o tipo de atualização 5. Formato IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)

Registro – Dados Fixos					
------------------------	--	--	--	--	--

Seq.	Nome do campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
9	Valor Ativo Subjacente ou Valor Ativo Subjacente Fluxo de Caixa ou Valor Índice Cesta	9(12),9(8)	62 a 81		Valor Ativo Subjacente. Coe calculado. Atualização tipo 4. Valor Ativo Subjacente Fluxo de Caixa. Atualização tipo 7. Formato: IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
10	Valor Inicial Ativo Subjacente ou Valor Inicial do Ativo Subjacente Lookback ou Valor de Referência	9(12),9(8)	82 a 101		Valor Inicial do Ativo Subjacente. Coe calculado com proteção contra proventos SIM - EMISSOR. O valor deve ser maior do que 0(zero). Atualização tipo 1. Valor Inicial do Ativo Subjacente Lookback. Atualização tipo 9. Valor de Referência. Ajuste no Valor Inicial do Ativo Subjacente. Atualização tipo 8. Formato: IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
11	Cotação Moeda	9(6),9(6)	102 a 113		Valor Cotação Moeda. Coe calculado, classe do ativo internacional (taxas de câmbio, ações internacionais, índices internacionais, mercadorias internacionais) e variação quanto NÃO. Formato IIIIIIDDDDDDD 06 inteiros e 06 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
12	Valor Remunerador Renda Fixa ou Fator Correção Remunerador	9(12),9(8)	114 a 133		Valor Remunerador Renda Fixa (COEs sem Fluxo de Caixa) Apenas para COE's com remunerador do tipo IPCA VCP ou IBOVSPA VCP ou USD VCP. Fator Correção Remunerador (COEs com fluxo de caixa) Apenas para COE's com remunerador do tipo IPCA VCP ou Fluxo de Caixa de COE Simplificado. Formato: IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto).

(continua)

Registro – Dados Fixos					
Seq.	Nome do campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
13	Fator Path Dependent ou Fator Juros Remunerador	9(12),9(8)	134 a 153		Fator Path Dependent. Tipo atualização figura Path Dependent sem cotação automática ou remunerador adicional não calculado. Preencher caso atualização do Tipo 6. Fator Juros Remunerador Fluxo de Caixa remunerador IPCA VCP ou Fluxo de Caixa de COE Simplificado) Deverá ser preenchido com fator 1 no dia do vencimento caso não ocorra pagamento de juros. Preencher somente caso atualização do Tipo 3 e COE Fluxo de Caixa com Remunerador VCP ou Simplificado. Formato: IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
14	Data Referência Lookback	X(8)	154 a 161		Formato: AAMMDDDD Preencher caso atualização do tipo 9.
15	Valor Inicial do Ativo Subjacente Lookback	9(12),9(8)	162 a 181		Preenchimento Opcional. ValorAtivoSubjacente após Lookback. COE não calculado. Formato IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto) Preencher caso atualização do Tipo 8.
16	Código do Ativo Subjacente	X(10)	182 a 191		Preenchimento obrigatório apenas para COEs com Classe do Ativo Subjacente do tipo CESTA
17	Quantidade 1	9(8),9(8)	192 a 207		Campo de Preenchimento Opcional. Permitir preenchimento apenas quando o campo "Tipo Atualização" for preenchido com opção 1 ou 8.
18	Quantidade 2	9(8),9(8)	208 a 223		Campo de Preenchimento Opcional. Permitir preenchimento apenas quando o campo "Tipo Atualização" for preenchido com opção 1 ou 8.

(fim)