

LAYOUT EM IMPLEMENTAÇÃO

COE – DEZEMBRO_24

CONTEÚDO

1 ATUALIZAÇÕES.....	3
2 ENVIAR ARQUIVOS	4
2.1 Registro COE.....	4

1 ATUALIZAÇÕES

Atualizado em	Referência	Atualização
17/09/2024	Enviar Arquivos	Inclusão do domínio “Média” no campo “Critério de Lookback” para registro de COE, conforme divulgado no Comunicado Externo.

Legendas:

- Novos domínios
- Alteração de regra ou detalhamento
- Novo campo – Preenchimento opcional
- Novo arquivo
- Novo campo – Preenchimento obrigatório condicional
- Nova seção ou bloco

2 ENVIAR ARQUIVOS

2.1 Registro COE

COE – Certificado de Operações Estruturadas	
Nome do Arquivo	Tamanho do Registro: 1103 caracteres
Registro COE	
Descrição: Arquivo a ser utilizado para Registro de COE.	
Estrutura: Header, Registro – Dados Fixos e Registro – Dados Variáveis	

Header					
Seq	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	0001	Código da operação: 0001 - Registro COE
04	Participante	X(20)	11 a 30		Nome Simplificado do Emissor
05	Data	X(8)	31 a 38		Data da operação. Formato: AAAAMMDD.

*Os códigos para os campos "Remunerador no Vencimento" e "Funcionalidade" podem ser encontrados no link: ftp://ftp-t.cetip.com.br/Public/AAAAMMDD_Dominios_COE.txt

Registro – Dados Fixos					
Seq	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	1	Tipo Linha "Dados Fixos"
03	Código operação	X(4)	7 a 10	0001	Código da operação: Registro COE
04	Conta Emissor	9(8)	11 a 18	Obrigatório	Formato XXXXX40Y
05	Tipo COE	X(2)	19 a 20	Obrigatório	Código da Figura do COE. A lista de domínios encontra-se no arquivo público DTpFiguras.txt
06	Nome Fantasia COE	X(100)	21 a 120	Obrigatório	Código de referência externa
07	Data Emissão	X(8)	121 a 128	Obrigatório	Data da emissão. Formato: AAAAMMDD
08	Data Vencimento	X(8)	129 a 136	Obrigatório	Data de vencimento. Formato: AAAAMMDD
09	Quantidade	X(12)	137 a 148	Obrigatório	Quantidade emitida
10	Valor Unitário Emissão	9(12),9(8)	149 a 168	Obrigatório	Formato IXXXXXXXXXDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
11	Valor Financeiro Emissão	9(16),9(2)	169 a 186	Obrigatório	Formato IXXXXXXXXXDD 16 inteiros e 2 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
12	Emissão A Termo	X(8)	187 a 194		Data futura. Formato: AAAAMMDD.
13	Código ISIN	X(12)	195 a 206		Código ISIN do ativo que está sendo registrado. Código atribuído pela B3. ISIN – International Securities Identification Number.
14	Modalidade	X(02)	207 a 208	Obrigatório Domínio: {01; 02}	Informar: 01 - 'Capital investido garantido'

Registro – Dados Fixos					
Seq	Campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
					02 - 'Perda limitada ao capital investido'.

Registro – Dados Fixos					
Seq	Campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
15	%Capital Garantido	9(3),9(4)	209 a 215	Obrigatório	Formato IIIDDDD 03 inteiros e 04 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
16	%Base Aplicação	9(3),9(4)	216 a 222	Obrigatório	Formato IIIDDDD 03 inteiros e 04 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto)
17	Resolução CVM 8	X(1)	223 a 223	Obrigatório Domínio: {S; N}	Informar: S (sim) ou N (não).
18	Proteção Contra Proventos	X(02)	224 a 225	Domínio: {01; 02; 03}	Valores válidos: 01 para ' <i>SIM - AJUSTADO PELO EMISSOR</i> ', 02 para ' <i>SIM – B3</i> ; 03 para ' <i>NAO</i> '. Obrigatório para ativo com classe "Ações Nacionais". Se ativo subjacente não calculado, usar 01 ou 03 . Se ativo subjacente calculado, usar 02 ou 03 . Caso a classe de ativo "Ações Internacionais" usar 01 ou 03 . Para as demais classes não se aplica.
19	Posição do emissor no derivativo?	X(1)	226 a 226	Obrigatório Domínio: {C; V}	Comprada (C) ou Vendida (V).
20	Classe do Ativo Subjacente	X(30)	227 a 256	Obrigatório	Tipo indicador financeiro. A lista de domínios encontra-se no arquivo público Ativos_Subjacentes.txt
21	Ativo Subjacente	X(10)	257 a 266	Obrigatório	Código do Ativo Subjacente. A lista de domínios encontra-se no arquivo público Ativos_Subjacentes.txt Quando a ClasseAtivoSubjacente é 'CESTA', o AtivoSubjacente deve obrigatoriamente ser 'CESTA' também;
22	Valor Inicial Ativo Subjacente	9(12),9(8)	267 a 286	Obrigatório	Obrigatório, caso seja informada a data emissão a termo e/ou o ativo subjacente seja não capturado. Formato IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 08 decimais. Não colocar ',' (virgula) ou '.' (ponto) Não deve ser preenchido caso Classe do Ativo Subjacente seja 'CESTA'

Registro – Dados Fixos					
Seq	Campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
23	Remunerador no Vencimento	X(02)	287 a 288	Obrigatório. Domínio: {00; 01; 02; 03; 04; 05; 07; 08; 09}	Para Lista de Remuneradores possíveis, vide arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_COE.txt
24	Descrição remunerador	X(300)	289 a 588		Descrição opcional do remunerador. Preencher caso o remunerador seja 'IPCA VCP' ou "IBOVESPA VCP" ou "USD VCP".
25	%Remunerador Flutuante	9(4),9(4)	589 a 596		Obrigatório no caso de DI, USD e IBOVESPA. Demais casos não preencher. Formato IIIIDDDD. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto) .
26	Spread/Cupom	9(5),9(4)	597 a 605		Obrigatório no caso de "PRE" ou "NO PERÍODO". Opcional nos demais casos Formato IIIIDDDD. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto).
27	Base remunerador	X(02)	606 a 607	Domínio: {01; 02; 03}	Obrigatório no caso de DI ou PRE. Informar: 01 para '252 exp'; 02 para '360 exp' ; 03 para '360 lin'. Não pode ser preenchido quando Remunerador = No Período
28	Resgate Antecipado	X(02)	608 a 609	Obrigatório Domínio: {01; 03; 04}	Informar: 01 – Liquidez diária a mercado; 03 - Não tem condição de liquidez. 04 – Condição Específica
29	Variação Quanto	X(1)	610 a 610	Domínio: {S; N}	Obrigatório para as Taxas de Câmbio, ações internacionais, índices internacionais, Commodities. Informar: S (sim) ou N (não).
30	Valor Inicial Paridade	9(5),9(8)	611 a 623		Obrigatório se "Variação Quanto" = NÃO. Demais casos não preencher. Não deve ser preenchido caso Classe do Ativo Subjacente seja 'CESTA', mesmo se "Variação Quanto" = NÃO Formato IIIIDDDDDDDDD. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto).
31	Quantidade Campos Variáveis	9(3)	624 a 626		Quantidade de campos variáveis desse COE
32	Código Identificador	X(20)	627 a 646	Código do COE	Opcional

Registro – Dados Fixos					
Seq	Campo	Formato	Posição	Conteúdo	Descrição
33	Conta Escriturador	9(8)	647 a 654		Campo deve ser enviado vazio para os tipos de regime DEPOSITADO e REGISTRADO.
34	Entrega Física	X(1)	655 a 655	Domínio: {S}	Opcional para as classes: Ações e Títulos Privados . Não preencher se a classe for outra.
35	Fluxo de Caixa	X(1)	656 a 656	Domínio:{S}	Opcional.

36	Data Inicial Moeda Não Paridade Quanto	X(8)	657 a 664	Opcional	Formato: AAAAMMDD Não deve ser preenchido caso Classe do Ativo Subjacente seja 'CESTA'
37	Data Fixing Moeda Não Paridade Quanto	X(8)	665 a 672	Opcional	Formato: AAAAMMDD Não deve ser preenchido caso Classe do Ativo Subjacente seja 'CESTA'
38	Cotacao Inicial Remunerador	9(12),9(8)	673 a 692	Opcional	Formato: IIIIIIIIIIDDDDDDDDD 12 inteiros e 8 decimais. Não utilizar ',' (virgula) ou '.' (ponto).
39	Data Inicial Remunerador	X(8)	693 a 700	Opcional	Formato: AAAAMMDD
40	Data Fixing Remunerador	X(8)	701 a 708	Opcional	Formato: AAAAMMDD
41	Lookback	X(1)	709 a 709	Domínio: {S}	Opcional. Informar: S (sim)
42	Critério de Lookback	X(1)	710 a 710	Domínio: {0; 1}	Obrigatório se "Lookback = Sim" Vazio 0- Mínimo 1- Máximo 2-Média
43	Data Inicial Lookback	X(8)	711 a 718		Obrigatório se "Lookback = Sim" Formato: AAAAMMDD
44	Data Final Lookback	X(8)	719 a 726		Obrigatório se "Lookback = Sim" Formato: AAAAMMDD
45	Tipo de Regime	X(1)	727 a 727	Domínio: {D, R}	Obrigatório. D – Depositado; R- Registrado
46	Pagamento Extraordinário	X(1)	728 a 728	Domínio: {1; 2}	Opcional. 1 - Sim Final; 2 - Sim Fluxo
47	Descrição Entrega Física	X(300)	729 a 1028		Opcional quando campo Entrega Física = Sim Caso Entrega Física = Não, esse campo deverá estar vazio
48	Conta do Favorecido	9(08)	1029 a 1036		Código da conta própria ou de cliente 1 ou 2 do participante favorecido.
49	CPF/CNPJ Cliente	X(18)	1037 a 1054		Informar o CPF ou CNPJ do favorecido
50	Natureza Cliente	X(02)	1055 a 1056	PF e PJ	PF = Pessoa Física, PJ = Pessoa Jurídica
51	Meu Número	9(10)	1057 a 1066		Número de identificação da operação de Depósito
52	P.U.	9(12),9(8)	1067 a 1086		Informar o Preço Unitário
53	Modalidade	9(01)	1087 a 1087	0, 4 e 2	0 = Sem modalidade; 4= Bilateral, 2 = Bruta
54	Banco Liquidante	9(08)	1088 a 1095		Código do Banco Liquidante.
55	Condição Específica Resgate*	X(05)	1096 a 1100		Código do domínio da qualificação da Condição de Resgate Específica. (Não enviar 0. Preencher com espaços em brancos) Para Lista de Condições possíveis, vide arquivo público: AAAAMMDD_Dominios_COE.txt
56	Funcionalidade	X(2)	1101 a 1102	Domínio {01;02}	01 = Watermark performance; 02 = Performance acumulada
57	Filler	X(1)	1103 a 1103		Espaço reservado para futuras implementações

(continua)

*Os códigos para o campo “Condição Específica Resgate” podem ser encontrados no link:
ftp://ftp-t.cetip.com.br/Public/AAAAMMDD_Cadastro_Curvas_Moedas_Feeder_Dominios

Registro – Dados Variáveis					
Seq	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	2	Tipo Linha “Dados Variáveis”
03	Código operação	X(4)	7 a 10	0001	Código da operação: Registro COE
04	Data da Operação	X(8)	11 a 18	Obrigatório	Formato AAAAMMDD
05	Identificador do Campo	X(8)	19 a 26	Obrigatório	Identificador do campo variável. Valores possíveis no arquivo público DTpTipoDadosDerivativo.txt
06	Valor	X(300)	27 a 326	Obrigatório	Valor do campo. Para campos do tipo DOMINIO verificar valores possíveis no arquivo público DTpTipoDadosDerivativo.txt

(fim)