

Critérios para configuração do contrato de colateral (Collateral Contract Set-up)

I - Identificação das Contrapartes (Counterparty Identification)

Parte A (Party A)	Endereço (Address)

Parte B (Party B)	Endereço (Address)

II – Definição do Garantidor (Contract Set-up)

Parte A e Parte B são Garantidoras (Default is both ways) <input type="checkbox"/>	Apenas Parte A como Garantidora (Party A as Collateral Giver only) <input type="checkbox"/>	Apenas Parte B como Garantidora (Party B as Collateral Giver only) <input type="checkbox"/>
---	--	--

III - Notificação de Exposição (Exposure notification)

Notificação Bilateral (Matching Required)	Notificação Unilateral (Unilateral notification)		
<input type="checkbox"/>	Parte A (Party A)	<input type="checkbox"/>	Parte B (Party B) <input type="checkbox"/>

IV - Parâmetros de risco das Contrapartes (Counterparty risk parameters)

Valor Independente (Independent amount)

Parte A é a Garantidora (Party A is Collateral Giver) _____ R\$ (BRL)	Parte B é a Garantidora (Party B is Collateral Giver) _____ R\$ (BRL)
---	---

Threshold

Parte A é a Garantidora (Party A is Collateral Giver) _____ R\$ (BRL) ou/or Exposure Margin Tolerance Excess: % da exposição (% of the exposure) Deficit: % da exposição (% of the exposure)	Parte B é a Garantidora (Party B is Collateral Giver) _____ R\$ (BRL) ou/or Exposure Margin Tolerance Excess: % da exposição (% of the exposure) Deficit: % da exposição (% of the exposure)
---	---

Critérios para configuração do contrato de colateral (Collateral contract set-up)	Referência da cesta (Basket reference) Part A _____ Part B _____
--	---

V - Critérios de Elegibilidade (Collateral eligibility criteria)

País Emissor (Issuer country): Brasil

Tipo do Emissor (Issuer type): Público (Government)

Moeda (Currency): Real (BRL) (Brazilian Real)

VI - Emissões Específicas (Specific issues)

EXCLUIR Emissões Específicas (ISIN)
(EXCLUDE specific issues)

INCLUIR Emissões Específicas (ISIN)
(INCLUDE specific issues)

Deságio%
(% Margin)

_____	_____
_____	_____
_____	_____
_____	_____

VII - Rating do Ativo/Emissor (Security/Issuer ratings)

Se o rating do ativo garantidor não estiver disponível, indicar se o rating do emissor deve ser aplicado ou excluído. **(If security ratings are unavailable, indicate whether issuer ratings are to be applied by default or excluded)**

Rating do emissor (Applied by default) <input type="checkbox"/>	Excluído (Excluded) <input type="checkbox"/>
---	--

VIII - Método de Avaliação (Valuation method)

Selecionar o método de cálculo para aplicação do deságio no preço do ativo. **(Select the method for calculating the collateral value of a security)**

Método de Avaliação Europeu (padrão) (European valuation method (default)) <input type="checkbox"/>	Método de Avaliação Americano (U.S. valuation method) <input type="checkbox"/>
--	---

IX - Precificação (Pricing)

Preços acruados serão utilizados por padrão para calcular o valor do colateral. **(Dirty prices will be used by default to calculate collateral value)**

X - Valor Mínimo da Transferência **(Minimum Transfer Amount)**

R\$ (BRL)

XI - Moeda como Colateral **(Cash as Collateral)** R\$ (BRL)

XII - Ratings de Crédito **(Credit ratings)**

Se Aplicável, marcar os ratings elegíveis, indicar o % de deságio e definir o intervalo em anos para a aplicação do deságio de acordo com o vencimento. **(If applicable, tick eligible ratings, indicate % margin and define the range in years for haircut setting according to maturity)**

Rating (S&P/Moody's/Fitch)			Público (Government)		
			% Deságio por prazo até o vencimento (anos) (% Haircut per time to maturity (years))		
			≤	< x ≤	>
Longo Prazo (Long term)					
Todos (All)					
AAA	-	Aaa			
AA+	-	Aa1			
AA	-	Aa2			
AA-	-	Aa3			
A+	-	A1			
A	-	A2			
A-	-	A3			
BBB+	-	Baa1			
BBB	-	Baa2			
BBB-	-	Baa3			
BB+	-	Ba1			
BB	-	Ba2			
BB-	-	Ba3			
B+	-	B1			
B	-	B2			
B-	-	B3			
CCC	-	Caa			
CC	-	Caa			
C	-	Ca			
D					
Não Class. (Non-rated)					
Curto Prazo (Short term)					
Todos (All)					
A1+	-	P1			
A1	-	P1			

A2	-	P2		
A3	-	P3		
B				
C				
D				

XIII – Deságio Variável por Data da Cotação (Dynamic margin and price quotation age)

Público (Government)		
Período com a mesma cotação (dias úteis) (Dynamic Margin (business days))	Deságio Adicional % (Additional Margin%)	Inelegível Após (dias úteis) (Ineligible After (business days))
De (From) 0 a (to) dias (days)	0%	
De (From) a (to) dias (days)		
Acima de (Over) dias (days)		

XIV – Limites de concentração por rating de crédito (Concentration Limits per credit rating)

Informe os limites de concentração por Rating de crédito se aplicável. (Please add concentration limits per credit rating (if applicable))

			Público (Government)				Rating para todos (Rating for All) %
			%				
Rating (S&P / Moody's / Fitch)			Limite Total (Total Limit)	Limite Emissor (Issuer Limit)	Limite Ativo (Security Limit)	Valor em Dívida (Outstanding Amount)	
Longo Prazo (Long term)							
Todos (All)							
AAA	-	Aaa					
AA	-	Aa2					
A	-	A2					
BBB	-	Baa2					
BB	-	Ba2					
B	-	B2					
CCC	-	Caa					
CC	-	Caa					
C	-	Ca					
D							
Não Class. (Non-rated)							
Curto Prazo (Short term)							
Todos (All)							
A1+	-	P1					
A1	-	P1					
A2	-	P2					
A3	-	P3					
B							
C							

D					
---	--	--	--	--	--

XV – Concentração por tipo de Emissor (Concentration Limit per Issuer types)

Tipo de Emissor (Issuer Type)	Limite (Limit%)
Público (Government)	100%

XVI – Participante Notificador (Default Notifier Participant - Only for control of B3)

Garantido (Taker) ?	Garantido e Garantidor (Giver and Taker) ?
Sim	Não

Local e Data (Place and Date): _____

Por e em nome da Parte A (For and on behalf of Party A)

Assinatura Autorizada (Authorized Signature)

Assinatura Autorizada (Authorized Signature)

Nome Impresso (Name Print)

Nome Impresso (Name Print)

Título (Title)

Título (Title)

Participante (Participant)

Assinatura Autorizada (Authorized Signature)

Por e em nome da Parte B (For and on behalf of Party B)

Assinatura Autorizada (Authorized Signature)

Assinatura Autorizada (Authorized Signature)

Nome Impresso (Name Print)

Nome Impresso (Name Print)

Título (Title)

Título (Title)

Participante (Participant)

Assinatura Autorizada (Authorized Signature)