**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)** | Apenas Parte A como Garantidora **(Party A as Collateral Giver only)** | Apenas Parte B como Garantidora**(Party B as Collateral Giver only)** |
| **[ ]**  | [ ]  | [ ]  |

**III - Notificação de Exposição (Exposure notification)**

|  |  |
| --- | --- |
| **Notificação Bilateral****(Matching Required)** | **Notificação Unilateral****(Unilateral notification)** |
| **[ ]**  | Parte A **(Party A)** **[ ]**  | Parte B **(Party B)*****[ ]***  |

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

**Valor Independente (Independent amount)**

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

**Threshold**

|  |  |
| --- | --- |
| Parte A é a Garantidora **(Party A is Collateral Giver)** | Parte B é a Garantidora **(Party B is Collateral Giver)**  |
|       | **R$** **(BRL)** ou/or  |       | **R$** **(BRL)** ou/or  |
| Exposure Margin Tolerance | Exposure Margin Tolerance |
| Excess:      % da exposição **(% of the exposure)**Deficit:      % da exposição **(% of the exposure)** | 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)** [ ]  Privado **(Corporate)**

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

**VI - Emissores/Emissões Específicas (Specific issuers/issues)**

A exclusão ou inclusão de um emissor é baseada no nome deste emissor, conforme informações obtidas junto a provedores de informações financeiras. **(Exclusion or inclusion of specific issuer is based, by default, on the issuer name information from recognized securities data vendors)**

|  |  |
| --- | --- |
| **EXCLUIR Emissores Específicos** **(EXCLUDE specific issuers)** | **EXCLUIR Emissões Específicas (ISIN)****(EXCLUDE specific issues)**  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **INCLUIR Emissores Específicos** **(INCLUDE specific issuers)** | **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 excluido. **(If security ratings are unavailable, indicate whether issuer ratings are to be applied by default or excluded)**

|  |  |
| --- | --- |
| Rating do emissor **(Applied by default)** | Excluído **(Excluded)** |
| [ ]  | [ ]  |

**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)** | Método de Avaliação Americano**(U.S. valuation method)** |
| [ ]  | [ ]  |

**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)**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  | Público **(Government)** | Privado **(Corporate)** |
| **Rating****(S&P/Moody's/Fitch)** | % Deságio por prazo até o vencimento (anos)**(% Haircut per time to maturity (years)** **≤**    **< x ≤    >** | % 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) |       |
| Privado **(Corporate)**  |
| 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)** | Privado **(Corportate)** | 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 Divida **(Outstanding Amount)** | Limite Total **(Total Limit)** | Limite Emissor **(Issuer Limit)** | Limite Ativo **Security Limit** | Valor em Divida**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%)** | Tipo de Emissor **(Issuer Type)** | Limite **(Limit%)** |
| Público **(Government)** |       | Privado **(Corportate)** |       |

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

|  |  |
| --- | --- |
| Garantido **(Taker)** | Garantido e Garantidor **(Giver and Taker)** |
|       |       |

|  |
| --- |
| **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)** |