**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)** |