

SISTEMA DE COMPLIANCE - MANUAL DE REGRAS

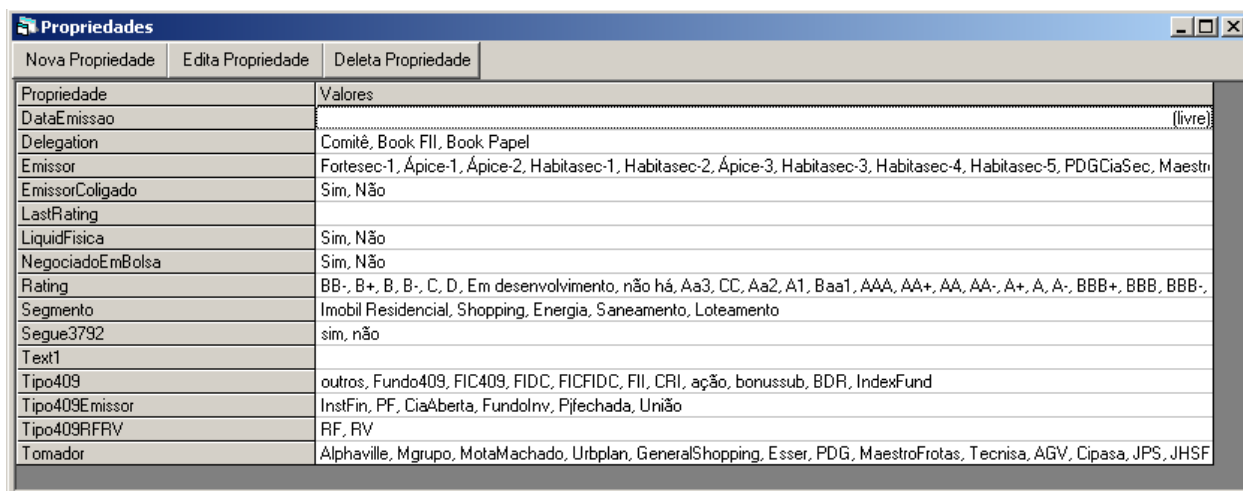
1) Propriedades

Cada característica dos títulos que serve para regras de compliance (emissor, rating, 3792, etc) é uma Propriedade.

Ao atualizar um título, é possível atualizar todas as suas propriedades.

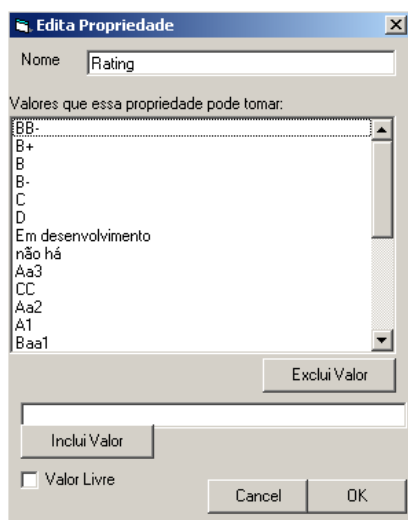
Há propriedades de Valor Livre, que podem ser preenchidas com qualquer valor, e propriedades tipo Lista, em que os valores são pré-definidos.

A lista de Propriedades mostra todas as propriedades e seus valores. Se for do tipo Lista, aparece a lista de valores; Se for do tipo Livre, aparece “(livre)”.



| Propriedades | |
|--------------------|--|
| Nova Propriedade | Edita Propriedade |
| Deleta Propriedade | |
| Propriedade | Valores |
| DataEmissao | (livre) |
| Delegation | Comitê, Book Fil, Book Papel |
| Emissor | Fortesec-1, Ápice-1, Ápice-2, Habitasec-1, Habitasec-2, Ápice-3, Habitasec-3, Habitasec-4, Habitasec-5, PDGCiaSec, Maestro |
| EmissorColigado | Sim, Não |
| LastRating | |
| LiquidFisica | Sim, Não |
| NegociadoEmBolsa | Sim, Não |
| Rating | BB-, B+, B, B-, C, D, Em desenvolvimento, não há, Aa3, CC, Aa2, A1, Baa1, AAA, AA+, AA, AA-, A+, A, A-, BBB+, BBB, BBB-, |
| Segmento | Imobil Residencial, Shopping, Energia, Saneamento, Loteamento |
| Segue3792 | sim, não |
| Text1 | |
| Tipo409 | outros, Fundo409, FIC409, FIDC, FICFIDC, FII, CRI, ação, bonussub, BDR, IndexFund |
| Tipo409Emissor | InstFin, PF, CiaAberta, FundInv, Pjfechada, União |
| Tipo409RFRV | RF, RV |
| Tomador | Alphaville, Mgrupo, MotaMachado, Urbplan, GeneralShopping, Esser, PDG, MaestroFrotas, Tecnisa, AGV, Cipasa, JPS, JHSF |

Você edita a propriedade escolhendo a linha e clicando “Edita Propriedade”. Aparece a tela de edição de propriedade, onde você pode escolher os valores listados (incluir ou excluir) e determinar se a propriedade é do tipo “Valor Livre” ou Lista.



Edita Propriedade

Nome: Rating

Valores que essa propriedade pode tomar:

- BB-
- B+
- B
- B-
- C
- D
- Em desenvolvimento
- não há
- Aa3
- CC
- Aa2
- A1
- Baa1

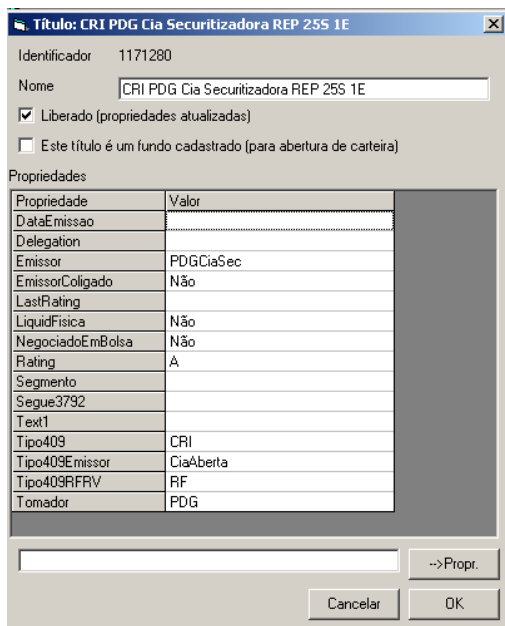
Exclui Valor

Inclui Valor

☐ Valor Livre

Cancel OK

Ao editar um título, aparece a lista de propriedades para atualização:



Título: CRI PDG Cia Securitizadora REP 255 1E

Identificador: 1171280

Nome: CRI PDG Cia Securitizadora REP 255 1E

☒ Liberado (propriedades atualizadas)

☐ Este título é um fundo cadastrado (para abertura de carteira)

Propriedades

| Propriedade | Valor |
|------------------|-----------|
| DataEmissao | |
| Delegation | |
| Emissor | PDGCiaSec |
| EmissorColigado | Não |
| LastRating | |
| LiquidFisica | Não |
| NegociadoEmBolsa | Não |
| Rating | A |
| Segmento | |
| Segue3792 | |
| Text1 | |
| Tipo409 | CRI |
| Tipo409Emissor | CiaAberta |
| Tipo409RFRV | RF |
| Tomador | PDG |

Cancel --> Propr. OK

Se a propriedade for do tipo Lista, pressionar a barra de espaço fará trocarem os valores em sequência. Se a propriedade for do tipo Valor Livre, ela terá um (L) após o nome, e clicando “→ Propr.” colocará na propriedade o que estiver escrito no campo à esquerda do botão.

2) Regras

Cada regra consiste em checar um limite de concentração do fundo. Somam-se os valores de todos os papéis que atendem às condições da regra e verifica-se se o total é maior ou menor que o limite percentual requerido pela regra.

A regra tem 4 partes:

- A) O tipo de limite (Máximo ou Mínimo), o valor de limite e o valor de 'warning'.
- B) Se a regra se aplica à carteira fechada ou à carteira aberta. Se à carteira aberta, cada título que for um Fundo terá o valor total explodido nos títulos componentes, e assim sucessivamente até não haver mais títulos que sejam Fundos.
- C) Se a regra será aplicada separadamente a cada grupo de títulos agrupado por uma propriedade. Por exemplo: se "Aplique a regra a cada grupo totalizado por" estiver marcado, e estiver selecionado "Emissor", a mesma regra será repetida para cada Emissor diferente.
- D) O escopo da regra, que é a condição para os títulos ingressarem na regra. "Aplique a regra apenas quando o seguinte critério for atendido", se marcado, determina que haverá um Escopo.

Escrevendo o escopo:

O escopo tem a forma de uma condição: Propriedade, comparador (igual, maior, etc), e constante comparativa.

No selecionador de Propriedade, se escolhe a propriedade a ser comparada.

No selecionador de comparador, se escolhe o tipo de teste:

"=": igual

">": maior

"<": menor

crPior: significa "pior rating de crédito" que o da constante

crMelhor: significa "melhor rating de crédito" que o da constante

<DaysAgo: significa "(o valor da propriedade) está a menos que x dias atrás", onde x é a constante

>DaysAgo: significa "(o valor da propriedade) está a mais que x dias atrás", onde x é a constante

crPior e crMelhor deve ser usado quando a propriedade contém um rating de crédito ("AAA", "BB+", etc).

<DaysAgo e >DaysAgo deve ser usado quando a propriedade contém uma data (no formato em inglês dd-mmm-yyyy).

A constante pode ser uma entrada só ou uma lista. Quando é uma lista, o comparador "igual" ("=") resulta em teste positivo se a Propriedade tiver qualquer um dos valores da lista (equivale a um conectivo "OU" entre os testes).

O botão "Clear" limpa toda a lista de constantes. O botão "←" introduz o valor selecionado à direita na lista. O campo à direita do "←" permite selecionar entre todos os valores possíveis da propriedade que figura na condição, e também permite uma entrada manual livre.