

REGULAMENTO DE EXECUÇÃO (UE) 2020/1225 DA COMISSÃO
de 29 de outubro de 2019

que estabelece normas técnicas de execução no que respeita ao formato e aos modelos normalizados para a disponibilização de informações e de dados sobre uma titularização pela entidade cedente, patrocinadora e pela EOET

(Texto relevante para efeitos do EEE)

A COMISSÃO EUROPEIA,

Tendo em conta o Tratado sobre o Funcionamento da União Europeia,

Tendo em conta o Regulamento (UE) 2017/2402 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 12 de dezembro de 2017, que estabelece um regime geral para a titularização e cria um regime específico para a titularização simples, transparente e padronizada, e que altera as Diretivas 2009/65/CE, 2009/138/CE e 2011/61/UE e os Regulamentos (CE) n.º 1060/2009 e (UE) n.º 648/2012 ⁽¹⁾, nomeadamente o artigo 7.º, n.º 4, e o artigo 17.º, n.º 3,

Considerando o seguinte:

- (1) O âmbito de aplicação do artigo 7.º, n.º 4, do Regulamento (UE) 2017/2402 refere-se a todas as titularizações, incluindo aquelas em que tem de ser elaborado um prospeto nos termos do Regulamento (UE) 2017/1129 ⁽²⁾ (geralmente designadas por titularizações «públicas») e em que não tem de ser elaborado esse prospeto (geralmente designadas por titularizações «privadas»). O artigo 17.º, n.º 3, do Regulamento (UE) 2017/2402 refere-se à disponibilização de informações sobre as titularizações através de um repositório de titularizações, o que não inclui as titularizações privadas.
- (2) As titularizações são operações complexas e heterogéneas. A fim de permitir uma recolha e avaliação eficiente dos dados pelos investidores, potenciais investidores, autoridades competentes e, no caso das titularizações públicas, pelas outras entidades enumeradas no artigo 17.º, n.º 1, do Regulamento (UE) 2017/2402, as informações referidas no artigo 7.º, n.º 1, alíneas a) e e), e no artigo 17.º, n.º 2, alínea a), do Regulamento (UE) 2017/2402 devem ser disponibilizadas num formato harmonizado. Além disso, quando as informações forem disponibilizadas através de um repositório de titularizações, um formato harmonizado facilita também a agregação e comparação entre os repositórios.
- (3) Os custos para os participantes no mercado devem ser reduzidos ao mínimo. O modelo de comunicação de informações sobre as titularizações deve, por conseguinte, ser semelhante, na medida do possível, ao formato prescrito para a comunicação de informações sobre os contratos de derivados nos termos do artigo 9.º do Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽³⁾ e para a comunicação de dados sobre as operações de financiamento através de valores mobiliários (OFVM) nos termos do artigo 4.º do Regulamento (UE) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽⁴⁾. Além disso, quando as informações são disponibilizadas através de um repositório de titularizações, o formato de comunicação deve também ter em conta as soluções desenvolvidas pelos atuais responsáveis pela recolha de dados sobre as titularizações. Por conseguinte, é adequado exigir a utilização do formato XML, correntemente utilizado para comunicar informações sobre os empréstimos e outras exposições subjacentes semelhantes, também no contexto da comunicação de informações sobre as titularizações.
- (4) As disposições do presente regulamento estão estreitamente interligadas, uma vez que determinam o formato e os modelos de acordo com os quais o cedente, o patrocinador ou a EOET envolvidos numa titularização devem disponibilizar informação sobre a mesma a diferentes partes, tal como exigido nos termos do Regulamento (UE) 2017/2402. Para assegurar a coerência entre estas disposições, que deverão entrar em vigor simultaneamente, e facilitar uma visão abrangente, bem como um acesso eficiente a todas as informações relevantes sobre uma titularização, é necessário incluir as normas técnicas de execução num único regulamento.

⁽¹⁾ JO L 347 de 28.12.2017, p. 35.

⁽²⁾ Regulamento (UE) 2017/1129 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 14 de junho de 2017, relativo ao prospeto a publicar em caso de oferta de valores mobiliários ao público ou da sua admissão à negociação num mercado regulamentado, e que revoga a Diretiva 2003/71/CE (JO L 168 de 30.6.2017, p. 12).

⁽³⁾ Regulamento (UE) n.º 648/2012 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 4 de julho de 2012, relativo aos derivados do mercado de balcão, às contrapartes centrais e aos repositórios de transações (JO L 201 de 27.7.2012, p. 1).

⁽⁴⁾ Regulamento (UE) 2015/2365 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 25 de novembro de 2015, relativo à transparência das operações de financiamento através de valores mobiliários e de reutilização e que altera o Regulamento (UE) n.º 648/2012 (JO L 337 de 23.12.2015, p. 1).

- (5) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de execução apresentados pela Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados (ESMA) à Comissão.
- (6) A ESMA realizou uma consulta pública aberta sobre os projetos de normas técnicas de regulamentação que servem de base ao presente regulamento, analisou os seus potenciais custos e benefícios e solicitou o parecer do Grupo de Interessados do Setor dos Valores Mobiliários e dos Mercados criado pelo artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽⁵⁾,

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

SECÇÃO 1

MODELOS PARA TODAS AS TITULARIZAÇÕES

Artigo 1.º

Modelo para as exposições subjacentes

1. As informações referidas no artigo 2.º, n.ºs 1 e 2, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 da Comissão ⁽⁶⁾ são disponibilizadas utilizando os seguintes modelos:
- a) O modelo estabelecido no anexo II do presente regulamento para os empréstimos aos agregados familiares garantidos por imóveis residenciais, independentemente da finalidade desses empréstimos;
 - b) O modelo estabelecido no anexo III do presente regulamento para os empréstimos destinados à aquisição de imóveis comerciais ou garantidos por imóveis comerciais;
 - c) O modelo estabelecido no anexo IV do presente regulamento para as exposições subjacentes ligadas às empresas, incluindo exposições subjacentes sobre micro, pequenas e médias empresas;
 - d) O modelo estabelecido no anexo V do presente regulamento para as exposições subjacentes ligadas ao sector automóvel, incluindo empréstimos e locações a pessoas singulares ou coletivas respaldados por veículos automóveis;
 - e) O modelo estabelecido no anexo VI do presente regulamento para as exposições subjacentes ligadas ao consumo;
 - f) O modelo estabelecido no anexo VII do presente regulamento para as exposições subjacentes ligadas a cartões de crédito;
 - g) O modelo estabelecido no anexo VIII do presente regulamento para as exposições subjacentes ligadas a locações;
 - h) O modelo estabelecido no anexo IX do presente regulamento para as exposições subjacentes que não se integram em nenhuma das categorias definidas nas alíneas a) a g).
2. As informações referidas no artigo 2.º, n.º 3, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando os seguintes modelos:
- a) Os modelos estabelecidos no n.º 1 do presente artigo, quando relevantes para o tipo de exposição subjacente;
 - b) O modelo estabelecido no anexo X para as titularizações de exposições não produtivas referidas no artigo 2.º, n.º 3, segundo parágrafo, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224.
3. As informações referidas no artigo 2.º, n.º 4, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando o modelo estabelecido no anexo XI.

⁽⁵⁾ Regulamento (UE) n.º 1095/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de novembro de 2010, que cria uma Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Europeia dos Valores Mobiliários e dos Mercados), altera a Decisão n.º 716/2009/CE e revoga a Decisão 2009/77/CE da Comissão (JO L 331 de 15.12.2010, p. 84).

⁽⁶⁾ Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 da Comissão, de 16 de outubro de 2019, que complementa o Regulamento (UE) 2017/2402 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam as informações e os dados sobre uma titularização a disponibilizar pela entidade cedente, patrocinadora e pela EOET (ver página 1 do presente Jornal Oficial).

*Artigo 2.º***Modelos dos relatórios destinados aos investidores**

1. As informações referidas no artigo 3.º, n.º 1, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando o modelo estabelecido no anexo XII.
2. As informações referidas no artigo 3.º, n.º 2, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando o modelo estabelecido no anexo XIII.

SECÇÃO 2

MODELOS PARA AS TITULARIZAÇÕES EM QUE TEM DE SER ELABORADO UM PROSPETO (TITULARIZAÇÕES PÚBLICAS)*Artigo 3.º***Modelos para a informação privilegiada**

1. As informações referidas no artigo 6.º, n.º 1, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando o modelo estabelecido no anexo XIV.
2. As informações referidas no artigo 6.º, n.º 2, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando o modelo estabelecido no anexo XV.

*Artigo 4.º***Modelos para os eventos significativos**

1. As informações referidas no artigo 7.º, n.º 1, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando o modelo estabelecido no anexo XIV.
2. As informações referidas no artigo 7.º, n.º 2, do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 são disponibilizadas utilizando o modelo estabelecido no anexo XV.

SECÇÃO 3

DISPOSIÇÕES COMUNS*Artigo 5.º***Formato das informações**

1. O formato das informações a fornecer através dos modelos constantes dos anexos I a XV deve ser conforme com o formato correspondente estabelecido no quadro 1 do anexo I.
2. As informações são disponibilizadas em formato eletrónico que permita a leitura por máquina, através de modelos XML comuns.

Artigo 6.º

Entrada em vigor

O presente regulamento entra em vigor no vigésimo dia seguinte ao da sua publicação no *Jornal Oficial da União Europeia*.

O presente regulamento é obrigatório em todos os seus elementos e diretamente aplicável em todos os Estados-Membros.

Feito em Bruxelas, em 29 de outubro de 2019.

Pela Comissão
O Presidente
Jean-Claude JUNCKER

ANEXO I

Formatos dos campos

SÍMBOLO	TIPO DE DADOS	DEFINIÇÃO
{ALPHANUM-n}	Até n caracteres alfanuméricos	Campo de texto livre. A preencher em formato ASCII e em letras maiúsculas (sem caracteres acentuados).
{COUNTRYCODE_2}	2 caracteres alfanuméricos	Código de país de 2 letras, conforme definido pela norma ISO 3166-1 alfa-2. A preencher em formato ASCII (sem caracteres acentuados).
{CURRENCYCODE_3}	3 caracteres alfanuméricos	Código de divisa de 3 letras, conforme definido pela norma ISO 4217. A preencher em formato ASCII (sem caracteres acentuados).
{YEAR}	Formato do ano de acordo com a norma ISO 8601	Os anos devem ser apresentados com o seguinte formato: AAAA
{DATEFORMAT}	Formato de data de acordo com a norma ISO 8601	As datas devem ser apresentadas com o seguinte formato: AAAA-MM-DD
{MONETARY}	0-18 dígitos, dos quais 5 no máximo poderão ser casas decimais	Um determinado número de unidades monetárias especificado numa moeda, em que a unidade monetária é explícita e conforme com a norma ISO 4217.
{NUMERIC}	0-18 dígitos, dos quais 5 no máximo poderão ser casas decimais	Até 18 caracteres numéricos, incluindo um máximo de 5 casas decimais. O separador decimal não conta como um carácter numérico. Se for utilizado, deve ser representado por um ponto.
{INTEGER-n}	Número inteiro até n	Campo numérico para valores inteiros positivos e negativos.
{Y/N}	1 carácter alfanumérico	«Verdadeiro» — Y «Falso» — N
{ISIN}	12 caracteres alfanuméricos	Código ISIN, conforme definido na norma ISO 6166
{LEI}	20 caracteres alfanuméricos	Identificador de entidade jurídica, conforme especificado na norma ISO 17442
{LIST}		Conforme indicado na descrição específica do campo
{NUTS}	5 caracteres alfanuméricos	Refere-se à Nomenclatura das Unidades Territoriais Estatísticas mantida pelo Eurostat. A informação deve ser disponibilizada ao nível NUTS3. http://ec.europa.eu/eurostat/web/nuts/
{NACE}	7 caracteres alfanuméricos	Refere-se à classificação estatística das atividades económicas na União Europeia, mantida no sítio Web citado nesta caixa de definição e conforme indicado no Regulamento (CE) n.º 1893/2006 do Parlamento Europeu e do Conselho ⁽¹⁾ . Para cada atividade económica, deve ser disponibilizado o nível de classificação mais pormenorizado (ou seja, o código completo – com 6 ou 7 caracteres, incluindo as casas decimais). http://ec.europa.eu/competition/mergers/cases/index/nace_all.html

SÍMBOLO	TIPO DE DADOS	DEFINIÇÃO
{PERCENTAGE}	0-11 dígitos, dos quais 10 no máximo poderão ser casas decimais	A taxa é expressa na forma de uma percentagem, isto é, em centésimas, pelo que, por exemplo, 0,7 representa 7/10 de um ponto percentual e 7,0 corresponde a 7%.
{TELEPHONE}	Um sinal «+» seguido do código do país (de 1 para 3 caracteres) e depois de um sinal «-» e, por fim, qualquer combinação de números e dos sinais «(,)», «+» e «-» (até 30 caracteres).	A recolha das informações que identificam um determinado número de telefone, tal como definido pelos serviços de telecomunicações.
{ESA}	7 caracteres alfanuméricos	O sector de acordo com o Sistema Europeu de Contas (2010), utilizando os códigos estabelecidos no quadro 1 do anexo I do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 a disponibilizar pela entidade cedente, patrocinadora e pela EOET ⁽²⁾ . http://ec.europa.eu/eurostat/cache/metadata/Annexes/nasa_10_f_esms_an1.pdf
{WATCHLIST}	2 caracteres alfanuméricos	O código da entidade gestora, conforme definido no quadro 2 do anexo I do Regulamento Delegado (UE) 2020/1224 a disponibilizar pela entidade cedente, patrocinadora e pela EOET.

⁽¹⁾ Regulamento (CE) n.º 1893/2006 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 20 de dezembro de 2006, que estabelece a nomenclatura estatística das atividades económicas NACE Revisão 2 e que altera o Regulamento (CEE) n.º 3037/90 do Conselho, assim como certos regulamentos CE relativos a domínios estatísticos específicos (JO L 393 de 30.12.2006, p. 1).

⁽²⁾ Regulamento Delegado (UE) 2020/1224, de 16 de outubro de 2019, que complementa o Regulamento (UE) 2017/2402 do Parlamento Europeu e do Conselho no que diz respeito às normas técnicas de regulamentação que especificam as informações e os dados sobre uma titularização a disponibilizar pela entidade cedente, patrocinadora e pela EOET (ver página 1 do presente Jornal Oficial).

ANEXO II

Modelo para as exposições subjacentes — Imóveis residenciais (RRE)

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
RREL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
RREL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
RREL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
RREL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
RREL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
RREL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
RREL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
RREL8	Data de recompra	{DATEFORMAT}
RREL9	Data de reembolso	{DATEFORMAT}
RREL10	Residente	{Y/N}
RREL11	Região geográfica — Devedor	{NUTS}
RREL12	Classificação da região geográfica	{YEAR}
RREL13	Situação profissional	{LIST}
RREL14	Devedor em imparidade de crédito	{Y/N}
RREL15	Tipo de cliente	{LIST}
RREL16	Rendimento primário	{MONETARY}
RREL17	Tipo de rendimento primário	{LIST}
RREL18	Moeda do rendimento primário	{CURRENCYCODE_3}
RREL19	Verificação do rendimento primário	{LIST}
RREL20	Rendimento secundário	{MONETARY}
RREL21	Verificação do rendimento secundário	{LIST}
RREL22	Regime especial	{ALPHANUM-10000}
RREL23	Data da originação	{DATEFORMAT}
RREL24	Data de vencimento	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
RREL25	Prazo de vencimento original	{INTEGER-9999}
RREL26	Canal de originação da titularização	{LIST}
RREL27	Objetivo	{LIST}
RREL28	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
RREL29	Saldo de capital original	{MONETARY}
RREL30	Saldo de capital atual	{MONETARY}
RREL31	Saldos de capital prioritários	{MONETARY}
RREL32	Exposições subjacentes <i>pari passu</i>	{MONETARY}
RREL33	Limite total de crédito	{MONETARY}
RREL34	Preço de compra	{PERCENTAGE}
RREL35	Tipo de amortização	{LIST}
RREL36	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
RREL37	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
RREL38	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}
RREL39	Pagamentos devidos	{MONETARY}
RREL40	Rácio dívida/rendimento	{PERCENTAGE}
RREL41	Montante balão (<i>balloon amount</i>)	{MONETARY}
RREL42	Tipo de taxa de juro	{LIST}
RREL43	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
RREL44	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
RREL45	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
RREL46	Margem de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
RREL47	Intervalo de refixação da taxa de juro	{INTEGER-9999}
RREL48	Limite máximo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
RREL49	Limite mínimo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
RREL50	Margem de revisão 1	{PERCENTAGE}
RREL51	Data de revisão da taxa de juro 1	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
RREL52	Margem de revisão 2	{PERCENTAGE}
RREL53	Data de revisão da taxa de juro 2	{DATEFORMAT}
RREL54	Margem de revisão 3	{PERCENTAGE}
RREL55	Data de revisão da taxa de juro 3	{DATEFORMAT}
RREL56	Índice de referência da taxa de juro revista	{LIST}
RREL57	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro revista	{LIST}
RREL58	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
RREL59	Percentagem de pagamentos antecipados autorizados por ano	{PERCENTAGE}
RREL60	Data final para a possibilidade de pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
RREL61	Comissão por pagamento antecipado	{MONETARY}
RREL62	Data final para as comissões por pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
RREL63	Data do pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
RREL64	Valor acumulado dos pagamentos antecipados	{MONETARY}
RREL65	Data de reestruturação	{DATEFORMAT}
RREL66	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
RREL67	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
RREL68	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
RREL69	Situação da conta	{LIST}
RREL70	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
RREL71	Montante em incumprimento	{MONETARY}
RREL72	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
RREL73	Perdas afetadas	{MONETARY}
RREL74	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
RREL75	Litígios	{Y/N}
RREL76	Meios de recurso	{Y/N}
RREL77	Montante dos depósitos	{MONETARY}
RREL78	Prestador de serviços de seguros ou de investimento	{ALPHANUM-1000}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
RREL79	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
RREL80	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
RREL81	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}
RREL82	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
RREL83	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
RREL84	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}

Secção de informação ao nível das cauções

RREC1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
RREC2	Identificador da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
RREC3	Identificador das cauções originais	{ALPHANUM-1000}
RREC4	Identificador das novas cauções	{ALPHANUM-1000}
RREC5	Tipo de caução	{LIST}
RREC6	Região geográfica - Cauções	{NUTS}
RREC7	Tipo de ocupação	{LIST}
RREC8	Ónus	{INTEGER-9999}
RREC9	Tipo de propriedade	{LIST}
RREC10	Valor do certificado de desempenho energético	{LIST}
RREC11	Nome do fornecedor do certificado de desempenho energético	{ALPHANUM-100}
RREC12	Rácio empréstimo/valor atual	{PERCENTAGE}
RREC13	Montante da avaliação atual	{MONETARY}
RREC14	Método da avaliação atual	{LIST}
RREC15	Data da avaliação atual	{DATEFORMAT}
RREC16	Rácio empréstimo/valor original	{PERCENTAGE}
RREC17	Montante da avaliação original	{MONETARY}
RREC18	Método da avaliação original	{LIST}
RREC19	Data da avaliação original	{DATEFORMAT}
RREC20	Data da venda	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
RREC21	Preço de venda	{MONETARY}
RREC22	Moeda da caução	{CURRENCYCODE_3}
RREC23	Tipo de garante	{LIST}

ANEXO III

Modelo para as exposições subjacentes — Imóveis comerciais (CRE)

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
CREL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
CREL2	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
CREL3	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
CREL4	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
CREL5	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
CREL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
CREL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
CREL8	Data de reestruturação	{DATEFORMAT}
CREL9	Data de recompra	{DATEFORMAT}
CREL10	Data de substituição	{DATEFORMAT}
CREL11	Data de reembolso	{DATEFORMAT}
CREL12	Região geográfica - Devedor	{NUTS}
CREL13	Classificação da região geográfica	{YEAR}
CREL14	Regime especial	{ALPHANUM-10000}
CREL15	Data da originação	{DATEFORMAT}
CREL16	Data de início da amortização	{DATEFORMAT}
CREL17	Data de vencimento à data da titularização	{DATEFORMAT}
CREL18	Data de vencimento	{DATEFORMAT}
CREL19	Prazo de vencimento original	{INTEGER-9999}
CREL20	Duração da opção de prorrogação	{INTEGER-9999}
CREL21	Natureza da opção de prorrogação	{LIST}
CREL22	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
CREL23	Saldo de capital atual	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREL24	Saldo de capital original	{MONETARY}
CREL25	Saldo de capital original à data da titularização	{MONETARY}
CREL26	Saldo da exposição subjacente resultante da parte não utilizada de uma linha de crédito concedida	{MONETARY}
CREL27	Total de outros montantes em dívida	{MONETARY}
CREL28	Preço de compra	{PERCENTAGE}
CREL29	Data mais recente de utilização	{DATEFORMAT}
CREL30	Objetivo	{LIST}
CREL31	Estrutura	{LIST}
CREL32	Pagamentos de juros programados antes da execução na cascata A-B	{LIST}
CREL33	Pagamentos de capital programados antes da execução na cascata A-B	{LIST}
CREL34	Afetação dos pagamentos de capital ao empréstimo não subordinado	{PERCENTAGE}
CREL35	Tipo de cascata	{LIST}
CREL36	Preço de compra da exposição subjacente em incumprimento	{PERCENTAGE}
CREL37	Possibilidade de pagamentos para resolução do incumprimento?	{LIST}
CREL38	Há restrições à venda de empréstimos subordinados?	{Y/N}
CREL39	O detentor do empréstimo subordinado tem alguma ligação ao devedor?	{Y/N}
CREL40	Controlo do processo de recuperação pelo detentor do empréstimo subordinado	{Y/N}
CREL41	Os pagamentos em falta sobre créditos de hierarquia mais elevada constituem um incumprimento da exposição subjacente?	{Y/N}
CREL42	Os pagamentos em falta sobre exposições subjacentes com a mesma hierarquia resultam na perda do imóvel?	{Y/N}
CREL43	Consentimento do detentor	{Y/N}
CREL44	Assembleia ordinária dos detentores	{DATEFORMAT}
CREL45	Sindicado	{Y/N}
CREL46	Participação de uma EOET	{LIST}
CREL47	Consequências do incumprimento do acordo financeiro	{LIST}
CREL48	Sanções pela não apresentação de informação financeira	{Y/N}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREL49	Meios de recurso	{Y/N}
CREL50	Recurso - Terceiros	{Y/N}
CREL51	Normas de gestão	{Y/N}
CREL52	Montantes detidos em depósito de garantia	{MONETARY}
CREL53	Mobilização dos depósitos de garantia	{Y/N}
CREL54	Mobilização de outras reservas	{Y/N}
CREL55	Evento desencadeador da mobilização do depósito de garantia	{LIST}
CREL56	Montantes previstos dos depósitos de garantia/reservas	{MONETARY}
CREL57	Condições para a libertação da conta de depósito de garantia	{ALPHANUM-1000}
CREL58	Condições para o levantamento das reservas de caixa	{LIST}
CREL59	Moeda da conta de depósito de garantia	{CURRENCYCODE_3}
CREL60	Moeda dos pagamentos do depósito de garantia	{CURRENCYCODE_3}
CREL61	Saldo total das reservas	{MONETARY}
CREL62	Moeda em que é expresso o saldo das reservas	{CURRENCYCODE_3}
CREL63	Ocorrência de um evento desencadeador da mobilização dos depósitos de garantia	{Y/N}
CREL64	Montantes adicionados aos depósitos de garantia durante o período atual	{MONETARY}
CREL65	Receitas	{MONETARY}
CREL66	Despesas operacionais à data da titularização	{MONETARY}
CREL67	Despesas de capital à data da titularização	{MONETARY}
CREL68	Moeda das demonstrações financeiras	{CURRENCYCODE_3}
CREL69	Infração das obrigações de comunicação de informações pelo devedor	{Y/N}
CREL70	Método de cálculo do rácio de cobertura do serviço da dívida	{LIST}
CREL71	Indicador do rácio de cobertura do serviço da dívida à data da titularização	{LIST}
CREL72	Indicador mais recente do rácio de cobertura do serviço da dívida	{LIST}
CREL73	Rácio de cobertura do serviço da dívida à data da titularização	{PERCENTAGE}
CREL74	Rácio de cobertura do serviço da dívida atual	{PERCENTAGE}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREL75	Rácio empréstimo/valor original	{PERCENTAGE}
CREL76	Rácio empréstimo/valor atual	{PERCENTAGE}
CREL77	Rácio de cobertura dos juros à data da titularização	{PERCENTAGE}
CREL78	Rácio de cobertura dos juros atual	{PERCENTAGE}
CREL79	Método de cálculo do rácio de cobertura dos juros	{LIST}
CREL80	Número de imóveis à data da titularização	{INTEGER-9999}
CREL81	Número de imóveis à data de referência dos dados	{INTEGER-9999}
CREL82	Imóveis dados em caução da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
CREL83	Valor da carteira de imóveis à data da titularização	{MONETARY}
CREL84	Moeda de avaliação da carteira de imóveis à data da titularização	{CURRENCYCODE_3}
CREL85	Situação dos imóveis	{LIST}
CREL86	Data da avaliação à data da titularização	{DATEFORMAT}
CREL87	Tipo de amortização	{LIST}
CREL88	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
CREL89	Dias de carência permitidos	{INTEGER-9999}
CREL90	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
CREL91	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}
CREL92	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
CREL93	Descrição das condições de pagamento antecipado	{ALPHANUM-100}
CREL94	Data final para a possibilidade de pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CREL95	Data final para a compensação dos rendimentos	{DATEFORMAT}
CREL96	Comissão por pagamento antecipado	{MONETARY}
CREL97	Data final para as comissões por pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CREL98	Mobilizações de capital não previstas	{MONETARY}
CREL99	Data de liquidação/pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CREL100	Código da liquidação/pagamento antecipado	{LIST}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREL101	Excedente/défica de pagamento antecipado de juros	{MONETARY}
CREL102	Data de pagamento	{DATEFORMAT}
CREL103	Próxima data de ajustamento dos pagamentos	{DATEFORMAT}
CREL104	Próxima data de ajustamento dos pagamentos	{DATEFORMAT}
CREL105	Pagamentos devidos	{MONETARY}
CREL106	Taxa de juro original	{PERCENTAGE}
CREL107	Taxa de juro à data da titularização	{PERCENTAGE}
CREL108	Primeira data de ajustamento dos pagamentos	{DATEFORMAT}
CREL109	Tipo de taxa de juro	{LIST}
CREL110	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
CREL111	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CREL112	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CREL113	Margem de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
CREL114	Intervalo de refixação da taxa de juro	{INTEGER-9999}
CREL115	Índice de taxa atual	{PERCENTAGE}
CREL116	Data de determinação do índice	{DATEFORMAT}
CREL117	Incremento do arredondamento	{PERCENTAGE}
CREL118	Limite máximo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
CREL119	Limite mínimo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
CREL120	Taxa dos juros de mora atual	{PERCENTAGE}
CREL121	Capitalização dos juros autorizada	{Y/N}
CREL122	Convenção sobre a contagem dos dias	{LIST}
CREL123	Total previsto de capital e juros a pagar	{MONETARY}
CREL124	Total previsto de capital e juros pago	{MONETARY}
CREL125	Amortização negativa	{MONETARY}
CREL126	Juros diferidos	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREL127	Total dos défices de pagamento de capital e juros em dívida	{MONETARY}
CREL128	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
CREL129	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
CREL130	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
CREL131	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
CREL132	Montante em incumprimento	{MONETARY}
CREL133	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
CREL134	Juros em atraso	{Y/N}
CREL135	Juros de mora efetivos	{MONETARY}
CREL136	Situação da conta	{LIST}
CREL137	Perdas afetadas	{MONETARY}
CREL138	Proventos líquidos recebidos na liquidação	{MONETARY}
CREL139	Despesas de liquidação	{MONETARY}
CREL140	Calendário previsto das recuperações	{INTEGER-9999}
CREL141	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
CREL142	Data de início da execução	{DATEFORMAT}
CREL143	Código da estratégia de recuperação	{LIST}
CREL144	Modificação	{LIST}
CREL145	Situação de gestão especial	{Y/N}
CREL146	Data mais recente de transferência para a entidade gestora especial	{DATEFORMAT}
CREL147	Data mais recente de transferência para a entidade gestora principal	{DATEFORMAT}
CREL148	Determinação da impossibilidade de recuperação	{Y/N}
CREL149	Violação do acordo/evento desencadeador	{LIST}
CREL150	Data da violação do acordo	{DATEFORMAT}
CREL151	Data de resolução da violação do acordo	{DATEFORMAT}
CREL152	Código da entidade gestora na lista de escrutínio	{WATCHLIST}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREL153	Data de colocação da entidade gestora na lista de escrutínio	{DATEFORMAT}
CREL154	Prestador do <i>swap</i> de taxas de juro	{ALPHANUM-1000}
CREL155	Identificador de entidade jurídica do prestador do <i>swap</i> de taxas de juro	{LEI}
CREL156	Data de vencimento do <i>swap</i> de taxas de juro	{DATEFORMAT}
CREL157	Montante nocional do <i>swap</i> de taxas de juro	{MONETARY}
CREL158	Prestador do <i>swap</i> cambial	{ALPHANUM-1000}
CREL159	Identificador de entidade jurídica do prestador do <i>swap</i> cambial	{LEI}
CREL160	Data de vencimento do <i>swap</i> cambial	{DATEFORMAT}
CREL161	Montante nocional do <i>swap</i> cambial	{MONETARY}
CREL162	Taxa de câmbio para o <i>swap</i>	{PERCENTAGE}
CREL163	Outros prestadores de <i>swaps</i>	{ALPHANUM-1000}
CREL164	Identificador de entidade jurídica dos outros prestadores de <i>swaps</i>	{LEI}
CREL165	Obrigação de pagamento pelo devedor em caso de rescisão do <i>swap</i>	{LIST}
CREL166	Evento de cancelamento parcial ou total do <i>swap</i> durante o período atual	{LIST}
CREL167	Pagamento periódico líquido efetuado pelo prestador do <i>swap</i>	{MONETARY}
CREL168	Custos de rescisão imputáveis ao prestador de um <i>swap</i> para a exposição subjacente	{MONETARY}
CREL169	Défice de pagamento dos custos de rescisão de um <i>swap</i>	{MONETARY}
CREL170	Custos de rutura do <i>swap</i> devidos pela contraparte	{MONETARY}
CREL171	Próxima data de reinicialização do <i>swap</i>	{DATEFORMAT}
CREL172	Entidade patrocinadora	{ALPHANUM-100}
CREL173	Identificador de entidade jurídica do banco agente da sindicção	{LEI}
CREL174	Identificador de entidade jurídica da entidade gestora	{LEI}
CREL175	Nome da entidade gestora	{ALPHANUM-100}
CREL176	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
CREL177	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
CREL178	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREL179	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
CREL180	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
CREL181	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}
Secção de informação ao nível das cauções		
CREC1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
CREC2	Identificador da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
CREC3	Identificador das cauções originais	{ALPHANUM-1000}
CREC4	Identificador das novas cauções	{ALPHANUM-1000}
CREC5	Tipo de caução	{LIST}
CREC6	Nome do imóvel	{ALPHANUM-100}
CREC7	Endereço do imóvel	{ALPHANUM-1000}
CREC8	Região geográfica — Cauções	{NUTS}
CREC9	Código postal do imóvel	{ALPHANUM-100}
CREC10	Ónus	{INTEGER-9999}
CREC11	Situação do imóvel	{LIST}
CREC12	Tipo de propriedade	{LIST}
CREC13	Forma do título de propriedade	{LIST}
CREC14	Data da avaliação atual	{DATEFORMAT}
CREC15	Montante da avaliação atual	{MONETARY}
CREC16	Método da avaliação atual	{LIST}
CREC17	Base de avaliação atual	{LIST}
CREC18	Método da avaliação original	{LIST}
CREC19	Data de titularização das cauções	{DATEFORMAT}
CREC20	Percentagem afetada da exposição subjacente na data de titularização	{PERCENTAGE}
CREC21	Percentagem afetada da exposição subjacente atual	{PERCENTAGE}
CREC22	Avaliação no momento da titularização	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREC23	Nome do avaliador no momento da titularização	{ALPHANUM-100}
CREC24	Data da avaliação no momento da titularização	{DATEFORMAT}
CREC25	Ano de construção	{YEAR}
CREC26	Ano da última renovação	{YEAR}
CREC27	Número de unidades	{INTEGER-999999999}
CREC28	Área total em metros quadrados	{INTEGER-999999999}
CREC29	Área comercial	{INTEGER-999999999}
CREC30	Área residencial	{INTEGER-999999999}
CREC31	Área interior assoalhada útil validada	{Y/N}
CREC32	Ocupação à data	{DATEFORMAT}
CREC33	Ocupação económica no momento da titularização	{PERCENTAGE}
CREC34	Ocupação física no momento da titularização	{PERCENTAGE}
CREC35	Valor da parte vaga do imóvel na data de titularização	{MONETARY}
CREC36	Data dos dados financeiros no momento da titularização	{DATEFORMAT}
CREC37	Rendimento operacional líquido no momento da titularização	{MONETARY}
CREC38	Dados financeiros mais recentes à data de início	{DATEFORMAT}
CREC39	Dados financeiros mais recentes à data de termo	{DATEFORMAT}
CREC40	Rendimento mais recente	{MONETARY}
CREC41	Despesas de exploração mais recentes	{MONETARY}
CREC42	Despesas de capital mais recentes	{MONETARY}
CREC43	Arrendamento a pagar pelo terreno	{MONETARY}
CREC44	Média ponderada de duração dos arrendamentos	{INTEGER-9999}
CREC45	Prazo de arrendamento do imóvel	{DATEFORMAT}
CREC46	Rendimento das rendas anuais contratadas	{MONETARY}
CREC47	Rendimento que expira no prazo de 1-12 meses	{PERCENTAGE}
CREC48	Rendimento que expira no prazo de 13-24 meses	{PERCENTAGE}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CREC49	Rendimento que expira no prazo de 25-36 meses	{PERCENTAGE}
CREC50	Rendimento que expira no prazo de 37-48 meses	{PERCENTAGE}
CREC51	Rendimento que expira num prazo igual ou superior a 49 meses	{PERCENTAGE}

Secção de informação ao nível dos arrendatários

CRET1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
CRET2	Identificador da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
CRET3	Identificador das cauções	{ALPHANUM-1000}
CRET4	Identificador do arrendatário	{ALPHANUM-1000}
CRET5	Nome do arrendatário	{ALPHANUM-100}
CRET6	Código sectorial NACE	{NACE}
CRET7	Data de vencimento do contrato de arrendamento	{DATEFORMAT}
CRET8	Renda a pagar	{MONETARY}
CRET9	Moeda das rendas	{CURRENCYCODE_3}

ANEXO IV

Modelo para as exposições subjacentes — Empresas

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
CRPL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
CRPL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
CRPL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
CRPL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
CRPL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
CRPL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
CRPL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
CRPL8	Data de recompra	{DATEFORMAT}
CRPL9	Data de reembolso	{DATEFORMAT}
CRPL10	Região geográfica - Devedor	{NUTS}
CRPL11	Classificação da região geográfica	{YEAR}
CRPL12	Devedor em imparidade de crédito	{Y/N}
CRPL13	Tipo de cliente	{LIST}
CRPL14	Código sectorial NACE	{NACE}
CRPL15	Segmento «Basileia III» do devedor	{LIST}
CRPL16	Dimensão da empresa	{LIST}
CRPL17	Receitas	{MONETARY}
CRPL18	Dívida total	{MONETARY}
CRPL19	EBITDA	{MONETARY}
CRPL20	Valor da empresa	{MONETARY}
CRPL21	Fluxos de caixa livres	{MONETARY}
CRPL22	Data dos dados financeiros	{DATEFORMAT}
CRPL23	Moeda das demonstrações financeiras	{CURRENCYCODE_3}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CRPL24	Tipo de dívida	{LIST}
CRPL25	Contas a receber titularizadas	{LIST}
CRPL26	Número de identificação internacional de títulos	{ISIN}
CRPL27	Senioridade	{LIST}
CRPL28	Sindicado	{Y/N}
CRPL29	Operação alavancada	{Y/N}
CRPL30	Gerida por CLO	{Y/N}
CRPL31	Pagamento em espécie	{Y/N}
CRPL32	Regime especial	{ALPHANUM-10000}
CRPL33	Data da originação	{DATEFORMAT}
CRPL34	Data de vencimento	{DATEFORMAT}
CRPL35	Canal de originação da titularização	{LIST}
CRPL36	Objetivo	{LIST}
CRPL37	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
CRPL38	Saldo de capital original	{MONETARY}
CRPL39	Saldo de capital atual	{MONETARY}
CRPL40	Saldos de capital prioritários	{MONETARY}
CRPL41	Valor de mercado	{MONETARY}
CRPL42	Limite total de crédito	{MONETARY}
CRPL43	Preço de compra	{PERCENTAGE}
CRPL44	Data da opção de venda	{DATEFORMAT}
CRPL45	Preço de exercício da opção de compra	{MONETARY}
CRPL46	Tipo de amortização	{LIST}
CRPL47	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
CRPL48	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
CRPL49	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CRPL50	Pagamentos devidos	{MONETARY}
CRPL51	Montante balão (<i>baloon amount</i>)	{MONETARY}
CRPL52	Tipo de taxa de juro	{LIST}
CRPL53	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
CRPL54	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CRPL55	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CRPL56	Margem de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
CRPL57	Intervalo de refixação da taxa de juro	{INTEGER-9999}
CRPL58	Limite máximo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
CRPL59	Limite mínimo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
CRPL60	Margem de revisão 1	{PERCENTAGE}
CRPL61	Data de revisão da taxa de juro 1	{DATEFORMAT}
CRPL62	Margem de revisão 2	{PERCENTAGE}
CRPL63	Data de revisão da taxa de juro 2	{DATEFORMAT}
CRPL64	Margem de revisão 3	{PERCENTAGE}
CRPL65	Data de revisão da taxa de juro 3	{DATEFORMAT}
CRPL66	Índice de referência da taxa de juro revista	{LIST}
CRPL67	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro revista	{LIST}
CRPL68	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
CRPL69	Percentagem de pagamentos antecipados autorizados por ano	{PERCENTAGE}
CRPL70	Data final para a possibilidade de pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CRPL71	Comissão por pagamento antecipado	{MONETARY}
CRPL72	Data final para as comissões por pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CRPL73	Data do pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CRPL74	Valor acumulado dos pagamentos antecipados	{MONETARY}
CRPL75	Data de reestruturação	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CRPL76	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
CRPL77	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
CRPL78	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
CRPL79	Situação da conta	{LIST}
CRPL80	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
CRPL81	Montante em incumprimento	{MONETARY}
CRPL82	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
CRPL83	Perdas afetadas	{MONETARY}
CRPL84	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
CRPL85	Fonte das recuperações	{LIST}
CRPL86	Meios de recurso	{Y/N}
CRPL87	Montante dos depósitos	{MONETARY}
CRPL88	Montante nocional do <i>swap</i> de taxas de juro	{MONETARY}
CRPL89	Identificador de entidade jurídica do prestador do <i>swap</i> de taxas de juro	{LEI}
CRPL90	Prestador do <i>swap</i> de taxas de juro	{ALPHANUM-1000}
CRPL91	Data de vencimento do <i>swap</i> de taxas de juro	{DATEFORMAT}
CRPL92	Montante nocional do <i>swap</i> cambial	{MONETARY}
CRPL93	Identificador de entidade jurídica do prestador do <i>swap</i> cambial	{LEI}
CRPL94	Prestador do <i>swap</i> cambial	{ALPHANUM-1000}
CRPL95	Data de vencimento do <i>swap</i> cambial	{DATEFORMAT}
CRPL96	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
CRPL97	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
CRPL98	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}
CRPL99	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
CRPL100	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
CRPL101	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação ao nível das cauções		
CRPC1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
CRPC2	Identificador da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
CRPC3	Identificador das cauções originais	{ALPHANUM-1000}
CRPC4	Identificador das novas cauções	{ALPHANUM-1000}
CRPC5	Região geográfica — Cauções	{NUTS}
CRPC6	Tipo de garantia	{LIST}
CRPC7	Tipo de encargo	{LIST}
CRPC8	Ónus	{INTEGER-9999}
CRPC9	Tipo de caução	{LIST}
CRPC10	Montante da avaliação atual	{MONETARY}
CRPC11	Método da avaliação atual	{LIST}
CRPC12	Data da avaliação atual	{DATEFORMAT}
CRPC13	Montante da avaliação original	{MONETARY}
CRPC14	Método da avaliação original	{LIST}
CRPC15	Data da avaliação original	{DATEFORMAT}
CRPC16	Data da venda	{DATEFORMAT}
CRPC17	Preço de venda	{MONETARY}
CRPC18	Moeda da caução	{CURRENCYCODE_3}
CRPC19	País do garante	{COUNTRYCODE_2}
CRPC20	Subsetor SEC do garante	{ESA}

ANEXO V

Modelo para as exposições subjacentes — Automóveis

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
AUTL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
AUTL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
AUTL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
AUTL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
AUTL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
AUTL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
AUTL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
AUTL8	Data de recompra	{DATEFORMAT}
AUTL9	Data de reembolso	{DATEFORMAT}
AUTL10	Região geográfica — Devedor	{NUTS}
AUTL11	Classificação da região geográfica	{YEAR}
AUTL12	Situação profissional	{LIST}
AUTL13	Devedor em imparidade de crédito	{Y/N}
AUTL14	Forma jurídica do devedor	{LIST}
AUTL15	Tipo de cliente	{LIST}
AUTL16	Rendimento primário	{MONETARY}
AUTL17	Tipo de rendimento primário	{LIST}
AUTL18	Moeda do rendimento primário	{CURRENCYCODE_3}
AUTL19	Verificação do rendimento primário	{LIST}
AUTL20	Receitas	{MONETARY}
AUTL21	Moeda das demonstrações financeiras	{CURRENCYCODE_3}
AUTL22	Regime especial	{ALPHANUM-10000}
AUTL23	Tipo de produto	{LIST}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
AUTL24	Data da originação	{DATEFORMAT}
AUTL25	Data de vencimento	{DATEFORMAT}
AUTL26	Prazo de vencimento original	{INTEGER-9999}
AUTL27	Canal de originação da titularização	{LIST}
AUTL28	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
AUTL29	Saldo de capital original	{MONETARY}
AUTL30	Saldo de capital atual	{MONETARY}
AUTL31	Preço de compra	{PERCENTAGE}
AUTL32	Tipo de amortização	{LIST}
AUTL33	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
AUTL34	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
AUTL35	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}
AUTL36	Método de pagamento	{LIST}
AUTL37	Pagamentos devidos	{MONETARY}
AUTL38	Montante balão (<i>baloon amount</i>)	{MONETARY}
AUTL39	Montante da entrada	{MONETARY}
AUTL40	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
AUTL41	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
AUTL42	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
AUTL43	Margem de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
AUTL44	Intervalo de refixação da taxa de juro	{INTEGER-9999}
AUTL45	Limite máximo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
AUTL46	Limite mínimo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
AUTL47	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
AUTL48	Percentagem de pagamentos antecipados autorizados por ano	{PERCENTAGE}
AUTL49	Comissão por pagamento antecipado	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
AUTL50	Data final para as comissões por pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
AUTL51	Data do pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
AUTL52	Valor acumulado dos pagamentos antecipados	{MONETARY}
AUTL53	Fabricante	{ALPHANUM-100}
AUTL54	Modelo	{ALPHANUM-100}
AUTL55	Data de matrícula	{YEAR}
AUTL56	Novo ou usado	{LIST}
AUTL57	Valor do certificado de desempenho energético	{LIST}
AUTL58	Nome do fornecedor do certificado de desempenho energético	{ALPHANUM-100}
AUTL59	Rácio empréstimo/valor original	{PERCENTAGE}
AUTL60	Montante da avaliação original	{MONETARY}
AUTL61	Valor residual do veículo original	{MONETARY}
AUTL62	Preço de exercício da opção de compra	{MONETARY}
AUTL63	Valor residual titularizado	{MONETARY}
AUTL64	Valor residual atualizado do veículo	{MONETARY}
AUTL65	Data de atualização do valor residual do veículo	{DATEFORMAT}
AUTL66	Data de reestruturação	{DATEFORMAT}
AUTL67	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
AUTL68	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
AUTL69	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
AUTL70	Situação da conta	{LIST}
AUTL71	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
AUTL72	Montante em incumprimento	{MONETARY}
AUTL73	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
AUTL74	Perdas afetadas	{MONETARY}
AUTL75	Perdas de valor residual	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
AUTL76	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
AUTL77	Preço de venda	{MONETARY}
AUTL78	Montante dos depósitos	{MONETARY}
AUTL79	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
AUTL80	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
AUTL81	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}
AUTL82	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
AUTL83	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
AUTL84	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}

ANEXO VI

Modelo para as exposições subjacentes — Consumo

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
CMRL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
CMRL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
CMRL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
CMRL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
CMRL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
CMRL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
CMRL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
CMRL8	Data de recompra	{DATEFORMAT}
CMRL9	Data de reembolso	{DATEFORMAT}
CMRL10	Região geográfica — Devedor	{NUTS}
CMRL11	Classificação da região geográfica	{YEAR}
CMRL12	Situação profissional	{LIST}
CMRL13	Devedor em imparidade de crédito	{Y/N}
CMRL14	Tipo de cliente	{LIST}
CMRL15	Rendimento primário	{MONETARY}
CMRL16	Tipo de rendimento primário	{LIST}
CMRL17	Moeda do rendimento primário	{CURRENCYCODE_3}
CMRL18	Verificação do rendimento primário	{LIST}
CMRL19	Garantido por afetação de remunerações/pensões	{Y/N}
CMRL20	Regime especial	{ALPHANUM-10000}
CMRL21	Data da originação	{DATEFORMAT}
CMRL22	Data de vencimento	{DATEFORMAT}
CMRL23	Prazo de vencimento original	{INTEGER-9999}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CMRL24	Canal de origem da titularização	{LIST}
CMRL25	Objetivo	{LIST}
CMRL26	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
CMRL27	Saldo de capital original	{MONETARY}
CMRL28	Saldo de capital atual	{MONETARY}
CMRL29	Limite total de crédito	{MONETARY}
CMRL30	Data final do período de renovação	{DATEFORMAT}
CMRL31	Preço de compra	{PERCENTAGE}
CMRL32	Tipo de amortização	{LIST}
CMRL33	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
CMRL34	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
CMRL35	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}
CMRL36	Pagamentos devidos	{MONETARY}
CMRL37	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
CMRL38	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CMRL39	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CMRL40	Margem de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
CMRL41	Intervalo de refixação da taxa de juro	{INTEGER-9999}
CMRL42	Limite máximo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
CMRL43	Limite mínimo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
CMRL44	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
CMRL45	Percentagem de pagamentos antecipados autorizados por ano	{PERCENTAGE}
CMRL46	Data final para a possibilidade de pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CMRL47	Comissão por pagamento antecipado	{MONETARY}
CMRL48	Data final para as comissões por pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
CMRL49	Data do pagamento antecipado	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CMRL50	Valor acumulado dos pagamentos antecipados	{MONETARY}
CMRL51	Data de reestruturação	{DATEFORMAT}
CMRL52	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
CMRL53	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
CMRL54	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
CMRL55	Situação da conta	{LIST}
CMRL56	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
CMRL57	Montante em incumprimento	{MONETARY}
CMRL58	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
CMRL59	Perdas afetadas	{MONETARY}
CMRL60	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
CMRL61	Montante dos depósitos	{MONETARY}
CMRL62	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
CMRL63	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
CMRL64	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}
CMRL65	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
CMRL66	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
CMRL67	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}
CMRL68	Valor do certificado de desempenho energético	{LIST}
CMRL69	Nome do fornecedor do certificado de desempenho energético	{ALPHANUM-100}

ANEXO VII

Modelo para as exposições subjacentes — Cartões de crédito

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
CCDL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
CCDL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
CCDL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
CCDL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
CCDL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
CCDL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
CCDL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
CCDL8	Data de recompra	{DATEFORMAT}
CCDL9	Região geográfica — Devedor	{NUTS}
CCDL10	Classificação da região geográfica	{YEAR}
CCDL11	Situação profissional	{LIST}
CCDL12	Devedor em imparidade de crédito	{Y/N}
CCDL13	Tipo de cliente	{LIST}
CCDL14	Rendimento primário	{MONETARY}
CCDL15	Tipo de rendimento primário	{LIST}
CCDL16	Moeda do rendimento primário	{CURRENCYCODE_3}
CCDL17	Verificação do rendimento primário	{LIST}
CCDL18	Regime especial	{ALPHANUM-10000}
CCDL19	Data da originação	{DATEFORMAT}
CCDL20	Canal de originação da titularização	{LIST}
CCDL21	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
CCDL22	Saldo de capital atual	{MONETARY}
CCDL23	Limite total de crédito	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
CCDL24	Preço de compra	{PERCENTAGE}
CCDL25	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
CCDL26	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
CCDL27	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}
CCDL28	Pagamentos devidos	{MONETARY}
CCDL29	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
CCDL30	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CCDL31	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
CCDL32	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
CCDL33	Data de reestruturação	{DATEFORMAT}
CCDL34	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
CCDL35	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
CCDL36	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
CCDL37	Situação da conta	{LIST}
CCDL38	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
CCDL39	Montante em incumprimento	{MONETARY}
CCDL40	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
CCDL41	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
CCDL42	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
CCDL43	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
CCDL44	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}
CCDL45	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
CCDL46	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
CCDL47	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}

ANEXO VIII

Modelo para as exposições subjacentes — Locação financeira

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
LESL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
LESL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
LESL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
LESL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
LESL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
LESL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
LESL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
LESL8	Data de recompra	{DATEFORMAT}
LESL9	Data de reembolso	{DATEFORMAT}
LESL10	Região geográfica — Devedor	{NUTS}
LESL11	Classificação da região geográfica	{YEAR}
LESL12	Devedor em imparidade de crédito	{Y/N}
LESL13	Segmento «Basileia III» do devedor	{LIST}
LESL14	Tipo de cliente	{LIST}
LESL15	Código sectorial NACE	{NACE}
LESL16	Dimensão da empresa	{LIST}
LESL17	Receitas	{MONETARY}
LESL18	Moeda das demonstrações financeiras	{CURRENCYCODE_3}
LESL19	Tipo de produto	{LIST}
LESL20	Sindicado	{Y/N}
LESL21	Regime especial	{ALPHANUM-10000}
LESL22	Data da originação	{DATEFORMAT}
LESL23	Data de vencimento	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
LESL24	Prazo de vencimento original	{INTEGER-9999}
LESL25	Canal de originação da titularização	{LIST}
LESL26	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
LESL27	Saldo de capital original	{MONETARY}
LESL28	Saldo de capital atual	{MONETARY}
LESL29	Preço de compra	{PERCENTAGE}
LESL30	Valor residual titularizado	{MONETARY}
LESL31	Tipo de amortização	{LIST}
LESL32	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
LESL33	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
LESL34	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}
LESL35	Pagamentos devidos	{MONETARY}
LESL36	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
LESL37	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
LESL38	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
LESL39	Margem de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
LESL40	Intervalo de refixação da taxa de juro	{INTEGER-9999}
LESL41	Limite máximo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
LESL42	Limite mínimo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
LESL43	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
LESL44	Percentagem de pagamentos antecipados autorizados por ano	{PERCENTAGE}
LESL45	Data final para a possibilidade de pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
LESL46	Comissão por pagamento antecipado	{MONETARY}
LESL47	Data final para as comissões por pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
LESL48	Data do pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
LESL49	Valor acumulado dos pagamentos antecipados	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
LESL50	Preço de exercício da opção de compra	{MONETARY}
LESL51	Montante da entrada	{MONETARY}
LESL52	Valor residual do ativo atual	{MONETARY}
LESL53	Data de reestruturação	{DATEFORMAT}
LESL54	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
LESL55	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
LESL56	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
LESL57	Situação da conta	{LIST}
LESL58	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
LESL59	Montante em incumprimento	{MONETARY}
LESL60	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
LESL61	Perdas afetadas	{MONETARY}
LESL62	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
LESL63	Fonte das recuperações	{LIST}
LESL64	Montante dos depósitos	{MONETARY}
LESL65	Região geográfica - Cauções	{NUTS}
LESL66	Fabricante	{ALPHANUM-100}
LESL67	Modelo	{ALPHANUM-100}
LESL68	Ano de fabrico/construção	{YEAR}
LESL69	Novo ou usado	{LIST}
LESL70	Valor residual original do ativo	{MONETARY}
LESL71	Tipo de caução	{LIST}
LESL72	Montante da avaliação original	{MONETARY}
LESL73	Método da avaliação original	{LIST}
LESL74	Data da avaliação original	{DATEFORMAT}
LESL75	Montante da avaliação atual	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
LESL76	Método da avaliação atual	{LIST}
LESL77	Data da avaliação atual	{DATEFORMAT}
LESL78	Número de objetos em locação financeira	{INTEGER-9999}
LESL79	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
LESL80	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
LESL81	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}
LESL82	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
LESL83	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
LESL84	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}

ANEXO IX

Modelo para as exposições subjacentes — Montagens esotéricas

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
ESTL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
ESTL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
ESTL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
ESTL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
ESTL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
ESTL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
ESTL7	Data de integração no conjunto	{DATEFORMAT}
ESTL8	Data de recompra	{DATEFORMAT}
ESTL9	Data de reembolso	{DATEFORMAT}
ESTL10	Descrição	{ALPHANUM-1000}
ESTL11	Região geográfica — Devedor	{NUTS}
ESTL12	Classificação da região geográfica	{YEAR}
ESTL13	Situação profissional	{LIST}
ESTL14	Devedor em imparidade de crédito	{Y/N}
ESTL15	Forma jurídica do devedor	{LIST}
ESTL16	Código sectorial NACE	{NACE}
ESTL17	Rendimento primário	{MONETARY}
ESTL18	Tipo de rendimento primário	{LIST}
ESTL19	Moeda do rendimento primário	{CURRENCYCODE_3}
ESTL20	Verificação do rendimento primário	{LIST}
ESTL21	Receitas	{MONETARY}
ESTL22	Moeda das demonstrações financeiras	{CURRENCYCODE_3}
ESTL23	Número de identificação internacional de títulos	{ISIN}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
ESTL24	Data da originação	{DATEFORMAT}
ESTL25	Data de vencimento	{DATEFORMAT}
ESTL26	Moeda de denominação	{CURRENCYCODE_3}
ESTL27	Saldo de capital original	{MONETARY}
ESTL28	Saldo de capital atual	{MONETARY}
ESTL29	Limite total de crédito	{MONETARY}
ESTL30	Preço de compra	{PERCENTAGE}
ESTL31	Tipo de amortização	{LIST}
ESTL32	Data final do período de carência das amortizações de capital	{DATEFORMAT}
ESTL33	Frequência prevista das amortizações de capital	{LIST}
ESTL34	Frequência prevista dos pagamentos de juros	{LIST}
ESTL35	Pagamentos devidos	{MONETARY}
ESTL36	Rácio dívida/rendimento	{PERCENTAGE}
ESTL37	Montante balão (<i>baloon amount</i>)	{MONETARY}
ESTL38	Intervalo de refixação da taxa de juro	{INTEGER-9999}
ESTL39	Taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
ESTL40	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
ESTL41	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
ESTL42	Margem de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
ESTL43	Limite máximo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
ESTL44	Limite mínimo da taxa de juro	{PERCENTAGE}
ESTL45	Número de pagamentos antes da titularização	{INTEGER-9999}
ESTL46	Percentagem de pagamentos antecipados autorizados por ano	{PERCENTAGE}
ESTL47	Data final para a possibilidade de pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
ESTL48	Comissão por pagamento antecipado	{MONETARY}
ESTL49	Data final para as comissões por pagamento antecipado	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
ESTL50	Data do pagamento antecipado	{DATEFORMAT}
ESTL51	Valor acumulado dos pagamentos antecipados	{MONETARY}
ESTL52	Última data em que se registaram atrasos de pagamento	{DATEFORMAT}
ESTL53	Saldo dos pagamentos em atraso	{MONETARY}
ESTL54	Número de dias de mora	{INTEGER-9999}
ESTL55	Situação da conta	{LIST}
ESTL56	Motivo do incumprimento ou da execução das garantias	{LIST}
ESTL57	Montante em incumprimento	{MONETARY}
ESTL58	Data do incumprimento	{DATEFORMAT}
ESTL59	Perdas afetadas	{MONETARY}
ESTL60	Recuperações acumuladas	{MONETARY}
ESTL61	Nome da entidade cedente	{ALPHANUM-100}
ESTL62	Identificador de entidade jurídica da entidade cedente	{LEI}
ESTL63	País de estabelecimento da entidade cedente	{COUNTRYCODE_2}
ESTL64	Nome do credor original	{ALPHANUM-100}
ESTL65	Identificador de entidade jurídica do credor original	{LEI}
ESTL66	País de estabelecimento do credor original	{COUNTRYCODE_2}

Secção de informação ao nível das cauções

ESTC1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
ESTC2	Identificador da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
ESTC3	Identificador das cauções originais	{ALPHANUM-1000}
ESTC4	Identificador das novas cauções	{ALPHANUM-1000}
ESTC5	Região geográfica - Cauções	{NUTS}
ESTC6	Tipo de garantia	{LIST}
ESTC7	Tipo de encargo	{LIST}
ESTC8	Ónus	{INTEGER-9999}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
ESTC9	Tipo de caução	{LIST}
ESTC10	Montante da avaliação atual	{MONETARY}
ESTC11	Método da avaliação atual	{LIST}
ESTC12	Data da avaliação atual	{DATEFORMAT}
ESTC13	Rácio empréstimo/valor atual	{PERCENTAGE}
ESTC14	Montante da avaliação original	{MONETARY}
ESTC15	Método da avaliação original	{LIST}
ESTC16	Data da avaliação original	{DATEFORMAT}
ESTC17	Rácio empréstimo/valor original	{PERCENTAGE}
ESTC18	Data da venda	{DATEFORMAT}
ESTC19	Preço de venda	{MONETARY}
ESTC20	Moeda da caução	{CURRENCYCODE_3}

ANEXO X

Modelo para as exposições subjacentes — Acréscimo de capital para as exposições não produtivas

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
NPEL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
NPEL2	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
NPEL3	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
NPEL4	Identificador do devedor original	{ALPHANUM-1000}
NPEL5	Identificador do novo devedor	{ALPHANUM-1000}
NPEL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
NPEL7	Em insolvência	{Y/N}
NPEL8	Data do último contacto	{DATEFORMAT}
NPEL9	Falecido	{Y/N}
NPEL10	Estatuto jurídico	{LIST}
NPEL11	Tipo de procedimento judicial	{LIST}
NPEL12	Nome do procedimento judicial	{ALPHANUM-1000}
NPEL13	Processos judiciais concluídos	{ALPHANUM-1000}
NPEL14	Data de lançamento do processo judicial em curso	{DATEFORMAT}
NPEL15	Data de nomeação do administrador de insolvência	{DATEFORMAT}
NPEL16	Número de acórdãos em curso	{INTEGER-9999}
NPEL17	Número de acórdãos emitidos	{INTEGER-9999}
NPEL18	Data da emissão do pedido de pagamento por terceiro	{DATEFORMAT}
NPEL19	Data da emissão da carta de reserva de direitos	{DATEFORMAT}
NPEL20	Jurisdição competente	{COUNTRYCODE_2}
NPEL21	Data de obtenção da ordem de restituição da posse	{DATEFORMAT}
NPEL22	Observações relativas a outros processos em contencioso	{ALPHANUM-1000}
NPEL23	Legislação aplicável	{COUNTRYCODE_2}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
NPEL24	Descrição das modalidades de reembolso específicas	{ALPHANUM-1000}
NPEL25	Data de início do período de pagamento apenas de juros	{DATEFORMAT}
NPEL26	Data de termo do período de pagamento apenas de juros	{DATEFORMAT}
NPEL27	Data de início do período de juros fixos atual	{DATEFORMAT}
NPEL28	Data de termo do período de juros fixos atual	{DATEFORMAT}
NPEL29	Valor da taxa de juro de reversão atual	{PERCENTAGE}
NPEL30	Última data de pagamento	{DATEFORMAT}
NPEL31	Parte sindicada	{PERCENTAGE}
NPEL32	Entrada MARP	{DATEFORMAT}
NPEL33	Situação MARP	{LIST}
NPEL34	Nível das cobranças externas	{Y/N}
NPEL35	Plano de reembolsos	{Y/N}
NPEL36	Nível de diferimento dos pagamentos	{Y/N}
NPEL37	Data do primeiro diferimento de pagamento	{DATEFORMAT}
NPEL38	Número já registado de diferimentos de pagamento	{INTEGER-9999}
NPEL39	Remissão do capital	{MONETARY}
NPEL40	Data de remissão do capital	{DATEFORMAT}
NPEL41	Data de termo da remissão do capital	{DATEFORMAT}
NPEL42	Montante dos reembolsos ao abrigo do diferimento de pagamentos	{MONETARY}

Secção de informação ao nível das cauções

NPEC1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
NPEC2	Identificador da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
NPEC3	Identificador das cauções originais	{ALPHANUM-1000}
NPEC4	Identificador das novas cauções	{ALPHANUM-1000}
NPEC5	IVA a pagar	{PERCENTAGE}
NPEC6	Percentagem de conclusão	{PERCENTAGE}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
NPEC7	Estado de execução	{Y/N}
NPEC8	Estado de execução — Terceiros	{Y/N}
NPEC9	Montante afetado da hipoteca	{MONETARY}
NPEC10	Posição subjacente de hierarquia mais elevada	{MONETARY}
NPEC11	Descrição das ações de execução	{ALPHANUM-1000}
NPEC12	Montante da avaliação judicial	{MONETARY}
NPEC13	Data da avaliação judicial	{DATEFORMAT}
NPEC14	Preço de acordo com o mercado	{MONETARY}
NPEC15	Preço de oferta	{MONETARY}
NPEC16	Data de preparação do imóvel para a venda	{DATEFORMAT}
NPEC17	Data de colocação do imóvel no mercado	{DATEFORMAT}
NPEC18	Data da oferta no mercado	{DATEFORMAT}
NPEC19	Data da venda acordada	{DATEFORMAT}
NPEC20	Data contratada	{DATEFORMAT}
NPEC21	Data da primeira hasta pública	{DATEFORMAT}
NPEC22	Preço de reserva estabelecido pela autoridade judicial para a primeira hasta pública	{MONETARY}
NPEC23	Data da próxima hasta pública	{DATEFORMAT}
NPEC24	Preço de reserva estabelecido pela autoridade judicial para a próxima hasta pública	{MONETARY}
NPEC25	Data da última hasta pública	{DATEFORMAT}
NPEC26	Preço de reserva estabelecido pela autoridade judicial para a última hasta pública	{MONETARY}
NPEC27	Número de hastas públicas fracassadas	{INTEGER-9999}

Secção de informação sobre o histórico de cobranças

NPEH1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
NPEH2	Identificador da exposição subjacente	{ALPHANUM-1000}
NPEH[3-38]	Saldo por pagar em termos legais no mês n	{MONETARY}
NPEH[39-74]	Historial dos saldos vencidos no mês n	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
NPEH[75-110]	Historial dos reembolsos — Não decorrentes da venda de cauções no mês n	{MONETARY}
NPEH[111-146]	Historial dos reembolsos — Decorrentes da venda de cauções no mês n	{MONETARY}

ANEXO XI

Modelo para as exposições subjacentes — Papel comercial respaldado por ativos

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre as exposições subjacentes		
IVAL1	Identificador único — Programa ABCP	{ALPHANUM-28}
IVAL2	Identificador único — Operação ABCP	{ALPHANUM-36}
IVAL3	Identificador da exposição subjacente original	{ALPHANUM-1000}
IVAL4	Identificador da exposição subjacente nova	{ALPHANUM-1000}
IVAL5	Tipo de exposição subjacente	{LIST}
IVAL6	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
IVAL7	Região geográfica — Maior concentração de exposições 1	{NUTS}
IVAL8	Região geográfica — Maior concentração de exposições 2	{NUTS}
IVAL9	Região geográfica — Maior concentração de exposições 3	{NUTS}
IVAL10	Classificação da região geográfica	{YEAR}
IVAL11	Saldo de capital atual	{MONETARY}
IVAL12	Número de exposições subjacentes	{INTEGER-999999999}
IVAL13	Exposições em EUR	{MONETARY}
IVAL14	Exposições em GBP	{MONETARY}
IVAL15	Exposições em USD	{MONETARY}
IVAL16	Outras exposições	{MONETARY}
IVAL17	Prazo de vencimento residual máximo	{INTEGER-9999}
IVAL18	Prazo de vencimento residual mínimo	{INTEGER-9999}
IVAL19	Rácio empréstimo/valor atual	{PERCENTAGE}
IVAL20	Rácio dívida/rendimento	{PERCENTAGE}
IVAL21	Tipo de amortização	{MONETARY}
IVAL22	Frequência prevista dos pagamentos de capital acima de um mês	{MONETARY}
IVAL23	Frequência prevista dos pagamentos de juros acima de um mês	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
IVAL24	Contas a receber com taxa variável	{MONETARY}
IVAL25	Montante financiado	{MONETARY}
IVAL26	Diluições	{MONETARY}
IVAL27	Exposições recompradas	{MONETARY}
IVAL28	Exposições em incumprimento ou em imparidade de crédito no momento da titularização	{MONETARY}
IVAL29	Exposições em incumprimento	{MONETARY}
IVAL30	Exposições em incumprimento CRR	{MONETARY}
IVAL31	Radiações brutas durante o período	{MONETARY}
IVAL32	Pagamentos com um atraso de 1-29 dias	{PERCENTAGE}
IVAL33	Pagamentos com um atraso de 30-59 dias	{PERCENTAGE}
IVAL34	Pagamentos com um atraso de 60-89 dias	{PERCENTAGE}
IVAL35	Pagamentos com um atraso de 90-119 dias	{PERCENTAGE}
IVAL36	Pagamentos com um atraso de 120-149 dias	{PERCENTAGE}
IVAL37	Pagamentos com um atraso de 150-179 dias	{PERCENTAGE}
IVAL38	Pagamentos com um atraso igual ou superior a 180 dias	{PERCENTAGE}
IVAL39	Exposições reestruturadas	{PERCENTAGE}
IVAL40	Exposições reestruturadas (0-1 ano antes da transferência)	{MONETARY}
IVAL41	Exposições reestruturadas (1-3 anos antes da transferência)	{MONETARY}
IVAL42	Exposições reestruturadas (mais de 3 anos antes da transferência)	{MONETARY}
IVAL43	Exposições reestruturadas (Taxa de juro)	{MONETARY}
IVAL44	Exposições reestruturadas (Calendário de reembolsos)	{MONETARY}
IVAL45	Posições reestruturadas (Prazos de vencimento)	{MONETARY}
IVAL46	Exposições reestruturadas (0-1 ano antes da transferência e sem novos pagamentos em atraso)	{MONETARY}
IVAL47	Exposições reestruturadas (Sem novos pagamentos em atraso)	{MONETARY}
IVAL48	Exposições reestruturadas (Novos pagamentos em atraso)	{MONETARY}
IVAL49	Posições reestruturadas (Outros)	{MONETARY}

ANEXO XII

Modelo de comunicação de informações aos investidores — Titularização de papel comercial não respaldado por ativos

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre a titularização		
IVSS1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
IVSS2	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
IVSS3	Nome da titularização	{ALPHANUM-100}
IVSS4	Nome da entidade que comunica as informações	{ALPHANUM-100}
IVSS5	Pessoa de contacto na entidade que comunica as informações	{ALPHANUM-256}
IVSS6	Contacto telefónico da entidade que comunica as informações	{TELEPHONE}
IVSS7	Endereços de correio eletrónico da entidade que comunica as informações	{ALPHANUM-256}
IVSS8	Método de retenção dos riscos	{LIST}
IVSS9	Detentor dos riscos retidos	{LIST}
IVSS10	Tipo de exposição subjacente	{LIST}
IVSS11	Método de transferência dos riscos	{Y/N}
IVSS12	Medições/rácios de desencadeamento	{Y/N}
IVSS13	Data de termo do período de renovação/de arranque	{DATEFORMAT}
IVSS14	Recuperações de capital durante o período	{MONETARY}
IVSS15	Recuperações de juros durante o período	{MONETARY}
IVSS16	Cobranças de capital durante o período	{MONETARY}
IVSS17	Cobranças de juros durante o período	{MONETARY}
IVSS18	Levantamentos ao abrigo da linha de liquidez	{Y/N}
IVSS19	Excedente dos <i>spreads</i> da titularização	{MONETARY}
IVSS20	Mecanismo de absorção do excedente dos <i>spreads</i>	{Y/N}
IVSS21	Caução excedentária atual	{PERCENTAGE}
IVSS22	Taxa de pagamento antecipado constante anualizada	{PERCENTAGE}
IVSS23	Diluições	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
IVSS24	Radiações brutas durante o período	{MONETARY}
IVSS25	Exposições recompradas	{MONETARY}
IVSS26	Exposições reestruturadas	{MONETARY}
IVSS27	Taxa de incumprimento constante anualizada	{PERCENTAGE}
IVSS28	Exposições em incumprimento	{MONETARY}
IVSS29	Exposições em incumprimento CRR	{MONETARY}
IVSS30	Método de ponderação dos riscos	{LIST}
IVSS31	Probabilidade de incumprimento pelo devedor no intervalo [0,00%,0,10%)	{PERCENTAGE}
IVSS32	Probabilidade de incumprimento pelo devedor no intervalo [0,10%,0,25%)	{PERCENTAGE}
IVSS33	Probabilidade de incumprimento pelo devedor no intervalo[0,25%,1,00%)	{PERCENTAGE}
IVSS34	Probabilidade de incumprimento pelo devedor no intervalo [1,00%,7,50%)	{PERCENTAGE}
IVSS35	Probabilidade de incumprimento pelo devedor no intervalo [7,50%,20,00%)	{PERCENTAGE}
IVSS36	Probabilidade de incumprimento pelo devedor no intervalo [20,00%,100,00%)	{PERCENTAGE}
IVSS37	Estimativa interna do banco das perdas em caso de incumprimento	{PERCENTAGE}
IVSS38	Pagamentos com um atraso de 1-29 dias	{PERCENTAGE}
IVSS39	Pagamentos com um atraso de 30-59 dias	{PERCENTAGE}
IVSS40	Pagamentos com um atraso de 60-89 dias	{PERCENTAGE}
IVSS41	Pagamentos com um atraso de 90-119 dias	{PERCENTAGE}
IVSS42	Pagamentos com um atraso de 120-149 dias	{PERCENTAGE}
IVSS43	Pagamentos com um atraso de 150-179 dias	{PERCENTAGE}
IVSS44	Pagamentos com um atraso igual ou superior a 180 dias	{PERCENTAGE}

Secção de informação sobre testes/eventos/eventos desencadeadores

IVSR1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
IVSR2	Identificador do teste/evento/evento desencadeador original	{ALPHANUM-1000}
IVSR3	Identificador do teste/evento/evento desencadeador novo	{ALPHANUM-1000}
IVSR4	Descrição	{ALPHANUM-100000}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
IVSR5	Nível do limiar	{NUMERIC}
IVSR6	Valor real	{NUMERIC}
IVSR7	Situação	{Y/N}
IVSR8	Período de resolução	{INTEGER-9999}
IVSR9	Frequência de cálculo	{INTEGER-9999}
IVSR10	Consequências da violação das condições	{LIST}

Secção de informação sobre os fluxos de caixa

IVSF1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
IVSF2	Identificador do elemento de caixa original	{ALPHANUM-1000}
IVSF3	Identificador do elemento de caixa novo	{ALPHANUM-1000}
IVSF4	Elemento de caixa	{ALPHANUM-1000}
IVSF5	Montante pago durante o período	{MONETARY}
IVSF6	Posto de fundos disponíveis	{MONETARY}

ANEXO XIII

Modelo de comunicação de informações aos investidores — Titularização de papel comercial respaldado por ativos

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre o programa		
IVAS1	Identificador único — Programa ABCP	{ALPHANUM-28}
IVAS2	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
IVAS3	Nome da entidade que comunica as informações	{ALPHANUM-100}
IVAS4	Pessoa de contacto na entidade que comunica as informações	{ALPHANUM-256}
IVAS5	Contacto telefónico da entidade que comunica as informações	{TELEPHONE}
IVAS6	Endereços de correio eletrónico da entidade que comunica as informações	{ALPHANUM-256}
IVAS7	Medições/rácios de desencadeamento	{Y/N}
IVAS8	Exposições não conformes	{MONETARY}
IVAS9	Vida média ponderada	{INTEGER-9999}
IVAS10	Método de retenção dos riscos	{LIST}
IVAS11	Detentor dos riscos retidos	{LIST}
Secção de informação sobre a operação		
IVAN1	Identificador único — Programa ABCP	{ALPHANUM-28}
IVAN2	Identificador único — Operação ABCP	{ALPHANUM-36}
IVAN3	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
IVAN4	Código sectorial NACE	{NACE}
IVAN5	Método de retenção dos riscos	{LIST}
IVAN6	Detentor dos riscos retidos	{LIST}
IVAN7	Vida média ponderada	{INTEGER-9999}
Secção de informação sobre testes/eventos/eventos desencadeadores		
IVAR1	Identificador único — Operação ABCP	{ALPHANUM-36}
IVAR2	Identificador do teste/evento/evento desencadeador original	{ALPHANUM-1000}
IVAR3	Identificador do teste/evento/evento desencadeador novo	{ALPHANUM-1000}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
IVAR4	Descrição	{ALPHANUM-100000}
IVAR5	Situação	{Y/N}
IVAR6	Consequências da violação das condições	{LIST}

ANEXO XIV

Modelo de informação interna ou de evento significativo — Titularização de papel comercial não respaldado por ativos

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre a titularização		
SESS1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESS2	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
SESS3	Deixou de ser STS	{Y/N}
SESS4	Medidas corretivas	{Y/N}
SESS5	Medidas administrativas	{Y/N}
SESS6	Alteração significativa dos documentos da operação	{ALPHANUM-1000000}
SESS7	Perfeição da venda	{Y/N}
SESS8	Tipo de cascata atual	{LIST}
SESS9	Tipo de <i>Master Trust</i>	{LIST}
SESS10	Valor da EOET	{MONETARY}
SESS11	Valor de capital da EOET	{MONETARY}
SESS12	Número de contas da EOET	{INTEGER-999999999}
SESS13	Saldo de capital do título	{MONETARY}
SESS14	Parte do vendedor	{PERCENTAGE}
SESS15	Parte do financiamento	{PERCENTAGE}
SESS16	Receitas afetadas a esta série	{MONETARY}
SESS17	Referencial do <i>swap</i> de taxas de juro	{LIST}
SESS18	Data de vencimento do <i>swap</i> de taxas de juro	{DATEFORMAT}
SESS19	Montante nocional do <i>swap</i> de taxas de juro	{MONETARY}
SESS20	Moeda de pagamento do <i>swap</i> cambial	{CURRENCYCODE_3}
SESS21	Moeda de recebimento do <i>swap</i> cambial	{CURRENCYCODE_3}
SESS22	Taxa de câmbio do <i>swap</i> cambial	{PERCENTAGE}
SESS23	Data de vencimento do <i>swap</i> cambial	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SESS24	Montante nocional do <i>swap</i> cambial	{MONETARY}

Secção de informação ao nível da *tranche*/obrigação

SEST1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SEST2	Identificador da <i>tranche</i> original	{ALPHANUM-1000}
SEST3	Identificador da <i>tranche</i> nova	{ALPHANUM-1000}
SEST4	Número de identificação internacional de títulos	{ISIN}
SEST5	Nome da <i>tranche</i>	{ALPHANUM-100}
SEST6	Tipo de <i>tranche</i> /obrigação	{LIST}
SEST7	Moeda	{CURRENCYCODE_3}
SEST8	Saldo de capital original	{MONETARY}
SEST9	Saldo de capital atual	{MONETARY}
SEST10	Frequência do pagamento de juros	{LIST}
SEST11	Data de pagamento de juros	{DATEFORMAT}
SEST12	Data de pagamento do capital	{DATEFORMAT}
SEST13	Cupão atual	{PERCENTAGE}
SEST14	Margem/ <i>Spread</i> de taxa de juro atual	{PERCENTAGE}
SEST15	Limite mínimo do cupão	{PERCENTAGE}
SEST16	Limite máximo do cupão	{PERCENTAGE}
SEST17	Intervalos de aumento/redução do valor do cupão	{PERCENTAGE}
SEST18	Data de aumento/redução do valor do cupão	{DATEFORMAT}
SEST19	Convenção de dias úteis	{LIST}
SEST20	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
SEST21	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
SEST22	Data de emissão	{DATEFORMAT}
SEST23	Data de desembolso	{DATEFORMAT}
SEST24	Vencimento legal	{DATEFORMAT}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SEST25	Cláusula de extensão	{LIST}
SEST26	Próxima data de exercício da opção de compra	{DATEFORMAT}
SEST27	Limiar para a compra de exposições residuais	{ALPHANUM-1000}
SEST28	Próxima data de exercício da opção de venda	{DATEFORMAT}
SEST29	Convenção sobre a contagem dos dias	{LIST}
SEST30	Convenção de liquidação	{LIST}
SEST31	Ponto de conexão atual	{PERCENTAGE}
SEST32	Ponto de conexão original	{PERCENTAGE}
SEST33	Melhoria de crédito atual	{PERCENTAGE}
SEST34	Melhoria de crédito original	{PERCENTAGE}
SEST35	Fórmula para as melhorias de crédito	{ALPHANUM-1000}
SEST36	Tranches <i>pari-passu</i>	{ISIN}
SEST37	Tranches prioritárias	{ISIN}
SEST38	Balanço dos saldos de défice de capital em dívida	{MONETARY}
SEST39	Identificador de entidade jurídica do garante	{LEI}
SEST40	Nome do garante	{ALPHANUM-1000}
SEST41	Subsetor SEC do garante	{ESA}
SEST42	Tipo de proteção	{LIST}

Secção de informação ao nível das contas

SESA1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESA2	Identificador da conta original	{ALPHANUM-1000}
SESA3	Identificador da conta nova	{ALPHANUM-1000}
SESA4	Tipo de conta	{LIST}
SESA5	Meta de saldo da conta	{MONETARY}
SESA6	Saldo atual da conta	{MONETARY}
SESA7	Conta de amortizações	{Y/N}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
-----------------	---------------	---------

Secção de informação ao nível das contrapartes

SESP1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESP2	Identificador de entidade jurídica da contraparte	{LEI}
SESP3	Nome da contraparte	{ALPHANUM-100}
SESP4	Tipo de contraparte	{LIST}
SESP5	País de estabelecimento da contraparte	{COUNTRYCODE_2}
SESP6	Limiar de notação das contrapartes	{ALPHANUM-100000}
SESP7	Notação da contraparte	{ALPHANUM-100000}
SESP8	Identificador de entidade jurídica da fonte das notações da contraparte	{LEI}
SESP9	Nome da fonte das notações da contraparte	{ALPHANUM-100}

Secção de informação sobre a titularização CLO

SESC1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESC2	Data de termo do período em que a opção de compra não pode ser exercida	{DATEFORMAT}
SESC3	Tipo de CLO	{LIST}
SESC4	Período atual	{LIST}
SESC5	Data de início do período atual	{DATEFORMAT}
SESC6	Data de termo do período atual	{DATEFORMAT}
SESC7	Limite de concentração	{PERCENTAGE}
SESC8	Restrições — Prazo de vencimento legal	{PERCENTAGE}
SESC9	Restrições — Exposições subordinadas	{PERCENTAGE}
SESC10	Restrições — Exposições não produtivas	{PERCENTAGE}
SESC11	Restrições — Exposições PIK	{PERCENTAGE}
SESC12	Restrições — Exposições com cupão zero	{PERCENTAGE}
SESC13	Restrições — Exposições sobre capitais próprios	{PERCENTAGE}
SESC14	Restrições — Exposições decorrentes de participações	{PERCENTAGE}
SESC15	Restrições — Vendas discricionárias	{PERCENTAGE}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SESC16	Vendas discricionárias	{MONETARY}
SESC17	Reinvestimentos	{MONETARY}
SESC18	Restrições — Melhorias de crédito	{Y/N}
SESC19	Restrições — Ofertas de preços	{Y/N}
SESC20	Restrições — Negociação	{Y/N}
SESC21	Restrições — Emissões	{Y/N}
SESC22	Restrições — Resgates	{Y/N}
SESC23	Restrições — Refinanciamento	{Y/N}
SESC24	Restrições — Remuneração dos títulos	{Y/N}
SESC25	Restrições — Proteção de crédito	{Y/N}
SESC26	Período de liquidação das cauções	{INTEGER-9999}
SESC27	Liquidação das cauções — Isenção	{Y/N}

Secção de informação sobre os gestores de CLO

SESL1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESL2	Identificador de entidade jurídica do gestor de CLO	{LEI}
SESL3	Nome do gestor	{ALPHANUM-1000}
SESL4	Data de estabelecimento	{DATEFORMAT}
SESL5	Data de registo	{DATEFORMAT}
SESL6	Empregados	{INTEGER-9999}
SESL7	Empregados — CLO	{INTEGER-9999}
SESL8	Empregados — Recuperação	{INTEGER-9999}
SESL9	Ativos sob gestão	{MONETARY}
SESL10	Ativos sob gestão — Empréstimos alavancados	{MONETARY}
SESL11	Ativos sob gestão — CLO	{MONETARY}
SESL12	Ativos sob gestão — UE	{MONETARY}
SESL13	Ativos sob gestão — CLO da UE	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SESL14	Número de CLO da UE	{INTEGER-9999}
SESL15	Capital	{MONETARY}
SESL16	Capital — Retenção de riscos	{MONETARY}
SESL17	Hora de liquidação	{INTEGER-9999}
SESL18	Frequência de fixação dos preços	{INTEGER-9999}
SESL19	Taxa de incumprimento — 1 ano	{PERCENTAGE}
SESL20	Taxa de incumprimento — 5 anos	{PERCENTAGE}
SESL21	Taxa de incumprimento — 10 anos	{PERCENTAGE}

Secção de informação sobre a cobertura sintética

SESV1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESV2	Identificador do instrumento de proteção	{ALPHANUM-1000}
SESV3	Tipo de proteção	{LIST}
SESV4	Número de identificação internacional de títulos do instrumento de proteção	{ISIN}
SESV5	Nome do prestador de proteção	{ALPHANUM-100}
SESV6	Identificador de entidade jurídica do prestador de proteção	{LEI}
SESV7	Entidade pública com uma ponderação de risco igual a zero	{Y/N}
SESV8	Legislação aplicável	{COUNTRYCODE_2}
SESV9	Acordo-quadro ISDA	{LIST}
SESV10	Eventos de incumprimento e de cancelamento	{LIST}
SESV11	Tipo de titularização sintética	{Y/N}
SESV12	Moeda da proteção	{CURRENCYCODE_3}
SESV13	Montante nocional da proteção atual	{MONETARY}
SESV14	Montante nocional máximo da proteção	{MONETARY}
SESV15	Ponto de conexão da proteção	{PERCENTAGE}
SESV16	Ponto de desconexão da proteção	{PERCENTAGE}
SESV17	Número de identificação internacional de títulos dos títulos cobertos	{ISIN}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SESV18	Cobertura da proteção	{LIST}
SESV19	Data de termo da proteção	{DATEFORMAT}
SESV20	Limiares de significância	{Y/N}
SESV21	Condições de autorização dos pagamentos	{LIST}
SESV22	Possibilidade de pagamentos de ajustamento	{Y/N}
SESV23	Duração do período de recuperação	{INTEGER-9999}
SESV24	Obrigação de reembolso	{Y/N}
SESV25	Possibilidade de substituição das cauções	{Y/N}
SESV26	Requisitos de cobertura das cauções	{PERCENTAGE}
SESV27	Margem inicial das cauções	{MONETARY}
SESV28	Prazo de entrega das cauções	{INTEGER-9999}
SESV29	Liquidação	{LIST}
SESV30	Data de vencimento máxima autorizada	{DATEFORMAT}
SESV31	Índice para os pagamentos ao comprador da proteção atual	{LIST}
SESV32	Prazo de vencimento do índice para os pagamentos ao comprador da proteção atual	{LIST}
SESV33	Frequência de reinicialização dos pagamentos - Ao comprador da proteção	{LIST}
SESV34	Margem de taxa de juro para os pagamentos ao comprador da proteção atual	{PERCENTAGE}
SESV35	Taxa de juro para os pagamentos ao comprador da proteção atual	{PERCENTAGE}
SESV36	Índice para os pagamentos ao vendedor da proteção atual	{LIST}
SESV37	Prazo de vencimento do índice para os pagamentos ao vendedor da proteção atual	{LIST}
SESV38	Frequência de reinicialização dos pagamentos — Ao vendedor da proteção	{LIST}
SESV39	Margem de taxa de juro para os pagamentos ao vendedor da proteção atual	{PERCENTAGE}
SESV40	Taxa de juro para os pagamentos ao vendedor da proteção atual	{PERCENTAGE}
SESV41	Apoio ao excedente de <i>spread</i>	{Y/N}
SESV42	Definição do excedente de <i>spread</i>	{Y/N}
SESV43	Situação da proteção atual	{LIST}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SESV44	A falência constitui um evento de crédito	{Y/N}
SESV45	O não pagamento constitui um evento de crédito	{Y/N}
SESV46	A reestruturação constitui um evento de crédito	{Y/N}
SESV47	Evento de crédito	{Y/N}
SESV48	Pagamentos acumulados ao comprador da proteção	{MONETARY}
SESV49	Pagamentos de ajustamento acumulados ao comprador da proteção	{MONETARY}
SESV50	Pagamentos acumulados ao vendedor da proteção	{MONETARY}
SESV51	Pagamentos de ajustamento acumulados ao vendedor da proteção	{MONETARY}
SESV52	Montante sintético do saldo dos excedentes de <i>spread</i>	{MONETARY}

Secção de informação sobre as cauções do emitente

SESI1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESI2	Identificador do instrumento de proteção	{ALPHANUM-1000}
SESI3	Identificador dos instrumentos de caução originais	{ALPHANUM-1000}
SESI4	Identificador das novas cauções	{ALPHANUM-1000}
SESI5	Número de identificação internacional de títulos dos instrumentos de caução	{ISIN}
SESI6	Tipo de instrumentos de caução	{LIST}
SESI7	Subsetor SEC do emitente das cauções	{ESA}
SESI8	Identificador de entidade jurídica do emitente das cauções	{LEI}
SESI9	O emitente das cauções tem alguma ligação ao cedente?	{Y/N}
SESI10	Saldo em dívida atual	{MONETARY}
SESI11	Moeda do instrumento	{CURRENCYCODE_3}
SESI12	Data de vencimento	{DATEFORMAT}
SESI13	Margem de avaliação (<i>haircut</i>)	{PERCENTAGE}
SESI14	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
SESI15	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
SESI16	Taxa de juro dos depósitos em dinheiro atual	{PERCENTAGE}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SESI17	Nome da contraparte no acordo de recompra (<i>repo</i>)	{ALPHANUM-100}
SESI18	Identificador de entidade jurídica da contraparte no acordo de recompra (<i>repo</i>)	{LEI}
SESI19	Data de vencimento do acordo de recompra (<i>repo</i>)	{DATEFORMAT}

Secção para outras informações

SESO1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SESO2	Número da linha para outras informações	{INTEGER-9999}
SESO3	Outras informações	{ALPHANUM-1000}

ANEXO XV

Modelo de informação interna ou evento significativo — Titularização de papel comercial respaldado por ativos

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção de informação sobre o programa		
SEAS1	Identificador único — Programa ABCP	{ALPHANUM-28}
SEAS2	Data de referência dos dados	{DATEFORMAT}
SEAS3	Deixou de ser STS	{Y/N}
SEAS4	Medidas corretivas	{Y/N}
SEAS5	Medidas administrativas	{Y/N}
SEAS6	Alteração significativa dos documentos da operação	{ALPHANUM-100000}
SEAS7	Legislação aplicável	{COUNTRYCODE_2}
SEAS8	Dimensão da linha de liquidez	{INTEGER-9999}
SEAS9	Cobertura da linha de liquidez	{PERCENTAGE}
SEAS10	Intervalo de cobertura da linha de liquidez	{INTEGER-9999}
SEAS11	Data de vencimento da linha de liquidez	{DATEFORMAT}
SEAS12	Levantamentos ao abrigo da linha de liquidez	{Y/N}
SEAS13	Total da emissão	{MONETARY}
SEAS14	Emissão máxima	{MONETARY}
Secção de informação sobre a operação		
SEAR1	Identificador único — Programa ABCP	{ALPHANUM-28}
SEAR2	Identificador único — Operação ABCP	{ALPHANUM-36}
SEAR3	Número de programas que financiam a operação	{INTEGER-9999}
SEAR4	Deixou de ser STS	{Y/N}
SEAR5	A entidade cedente é cliente do patrocinador do programa	{Y/N}
SEAR6	Juros concedidos pelo título	{Y/N}
SEAR7	Receitas	{MONETARY}
SEAR8	Despesas operacionais	{MONETARY}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SEAR9	Ativos Correntes	{MONETARY}
SEAR10	Dinheiro líquido	{MONETARY}
SEAR11	Títulos transacionáveis	{MONETARY}
SEAR12	Contas a receber	{MONETARY}
SEAR13	Passivos correntes	{MONETARY}
SEAR14	Dívida total	{MONETARY}
SEAR15	Total dos capitais próprios	{MONETARY}
SEAR16	Moeda das demonstrações financeiras	{CURRENCYCODE_3}
SEAR17	Operação apoiada pela entidade patrocinadora	{LIST}
SEAR18	Tipo de apoio pela entidade patrocinadora	{Y/N}
SEAR19	Dimensão da linha de liquidez	{INTEGER-9999}
SEAR20	Montante mobilizado da linha de liquidez	{MONETARY}
SEAR21	Cobertura da linha de liquidez	{PERCENTAGE}
SEAR22	Intervalo de cobertura da linha de liquidez	{INTEGER-9999}
SEAR23	Tipo de linha de liquidez	{LIST}
SEAR24	Data de vencimento do acordo de recompra da linha de liquidez	{DATEFORMAT}
SEAR25	Moeda da linha de liquidez	{CURRENCYCODE_3}
SEAR26	Data de vencimento da linha de liquidez	{DATEFORMAT}
SEAR27	Nome do prestador da linha de liquidez	{ALPHANUM-100}
SEAR28	Identificador de entidade jurídica do prestador da linha de liquidez	{LEI}
SEAR29	Caução excedentária/Interesses subordinados	{PERCENTAGE}
SEAR30	Excedente dos <i>spreads</i> da operação	{MONETARY}
SEAR31	Nome do prestador das cartas de crédito	{ALPHANUM-100}
SEAR32	Identificador de entidade jurídica do prestador das cartas de crédito	{LEI}
SEAR33	Moeda da carta de crédito	{CURRENCYCODE_3}
SEAR34	Proteção máxima da carta de crédito	{PERCENTAGE}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SEAR35	Nome do garante	{ALPHANUM-100}
SEAR36	Identificador de entidade jurídica do garante	{LEI}
SEAR37	Cobertura máxima da garantia	{MONETARY}
SEAR38	Moeda da garantia	{CURRENCYCODE_3}
SEAR39	Data de vencimento da garantia	{DATEFORMAT}
SEAR40	Tipo de transferência das contas a receber	{LIST}
SEAR41	Data de vencimento do acordo de recompra	{DATEFORMAT}
SEAR42	Montante comprado	{MONETARY}
SEAR43	Limite máximo de financiamento	{MONETARY}
SEAR44	Referencial do <i>swap</i> de taxas de juro	{LIST}
SEAR45	Data de vencimento do <i>swap</i> de taxas de juro	{DATEFORMAT}
SEAR46	Montante nocional do <i>swap</i> de taxas de juro	{MONETARY}
SEAR47	Moeda de pagamento do <i>swap</i> cambial	{CURRENCYCODE_3}
SEAR48	Moeda de recebimento do <i>swap</i> cambial	{CURRENCYCODE_3}
SEAR49	Taxa de câmbio do <i>swap</i> cambial	{PERCENTAGE}
SEAR50	Data de vencimento do <i>swap</i> cambial	{DATEFORMAT}
SEAR51	Montante nocional do <i>swap</i> cambial	{MONETARY}

Secção de informação ao nível da *tranche*/obrigação

SEAT1	Identificador único — Programa ABCP	{ALPHANUM-28}
SEAT2	Identificador das obrigações originais	{ALPHANUM-1000}
SEAT3	Identificador da obrigação nova	{ALPHANUM-1000}
SEAT4	Número de identificação internacional de títulos	{ISIN}
SEAT5	Tipo de <i>tranche</i> /obrigação	{LIST}
SEAT6	Data de emissão	{DATEFORMAT}
SEAT7	Vencimento legal	{DATEFORMAT}
SEAT8	Moeda	{CURRENCYCODE_3}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
SEAT9	Saldo de capital atual	{MONETARY}
SEAT10	Cupão atual	{PERCENTAGE}
SEAT11	Índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
SEAT12	Prazo de vigência do índice de referência da taxa de juro atual	{LIST}
SEAT13	Frequência do pagamento de juros	{LIST}
SEAT14	Melhoria de crédito corrente	{PERCENTAGE}
SEAT15	Fórmula para as melhorias de crédito	{ALPHANUM-1000}

Secção de informação ao nível das contas

SEAA1	Identificador único — Operação ABCP	{ALPHANUM-36}
SEAA2	Identificador da conta original	{ALPHANUM-1000}
SEAA3	Identificador da conta nova	{ALPHANUM-1000}
SEAA4	Tipo de conta	{LIST}
SEAA5	Meta de saldo da conta	{MONETARY}
SEAA6	Saldo atual da conta	{MONETARY}
SEAA7	Conta de amortizações	{Y/N}

Secção de informação ao nível das contrapartes

SEAP1	Identificador único — Operação ABCP	{ALPHANUM-36}
SEAP2	Identificador de entidade jurídica da contraparte	{LEI}
SEAP3	Nome da contraparte	{ALPHANUM-100}
SEAP4	Tipo de contraparte	{LIST}
SEAP5	País de estabelecimento da contraparte	{COUNTRYCODE_2}
SEAP6	Limiar de notação das contrapartes	{ALPHANUM-100000}
SEAP7	Notação da contraparte	{ALPHANUM-100000}
SEAP8	Identificador de entidade jurídica da fonte das notações da contraparte	{LEI}
SEAP9	Nome da fonte das notações da contraparte	{ALPHANUM-100}

CÓDIGO DO CAMPO	NOME DO CAMPO	FORMATO
Secção para outras informações		
SEAO1	Identificador único	{ALPHANUM-28}
SEAO2	Número da linha para outras informações	{INTEGER-9999}
SEAO3	Outras informações	{ALPHANUM-1000}