

### Reporte

| <b>DIVULGAÇÃO/DILIGÊNCIAS DE OPERAÇÕES DE TITULARIZAÇÃO<br/>(durante a vigência ou o investimento)</b>  |
|---|
| Identificação da Operação de Titularização:<br>Data de Realização/Aquisição da Operação:<br>Prazo de Vencimento da Operação:<br>Nome do Emitente:<br>Notação de Risco do Emitente:  |
| <b>1.</b> Actualização dos elementos enviados na data de realização/aquisição (Anexo II à Instrução n.º 7/2008), tendo em conta a natureza da titularização. Eventuais alterações, materialmente relevantes, face à informação inicial ou à última informação disponibilizada devem ser devidamente justificadas (1)  |
| <b>2.</b> Avaliação/monitorização do desempenho das operações de titularização, tendo em conta os dados considerados materialmente relevantes. Tais como:<br><br><b>2.1</b> Qualidade do crédito e desempenho de cada uma das posições em risco subjacente (v.g. percentagem de empréstimos vencidos há mais de 30, 60 ou 90 dias; taxas de incumprimento; taxas de pagamento antecipado; empréstimos em execução)<br><br><b>2.2</b> Fluxos financeiros da operação, com a decomposição suficiente para permitir a realização de testes de esforço a estes fluxos pelos investidores<br><br><b>2.3</b> Valores dos colaterais, com a decomposição suficiente para permitir a realização de testes de esforço a estes instrumentos pelos investidores (v.g. tipo e percentagem afectada do colateral; distribuição da frequência do rácio <i>loan-to-value</i> com intervalos para permitir uma análise de sensibilidade adequada) |
| <b>3.</b> (APENAS PARA INVESTIDORES) Resultados dos testes de esforço e principais conclusões   |

#### Notas de Preenchimento – Reporte

- (1) Para re-titularizações, as instituições devem dispor, sempre que possível, dos elementos que constam no Anexo III tanto para as tranches de titularização subjacentes como para as posições em risco subjacentes a essas tranches.