

PROTOCOLO DE FALLBACKS DE IBORs DE 2020 DA ISDA

publicado em 23 de outubro de 2020 pela International Swaps and Derivatives Association, Inc.

A International Swaps and Derivatives Association, Inc. (**ISDA®**)¹ publicou este Protocolo de Fallbacks de IBORs de 2020 da ISDA (este **Protocolo**) para permitir que as partes de Documentos Abrangidos pelo Protocolo alterem os termos de cada Documento Abrangido pelo Protocolo para (i) com relação a um Documento Abrangido pelo Protocolo que incorpore, ou faça referência a uma taxa definida em, um Livro de Definições da ISDA Abrangido, incluir nos termos desse Documento Abrangido pelo Protocolo os termos do Suplemento às Definições da ISDA de 2006 ou um termo definido específico incluído no mesmo, finalizado em 23 de outubro de 2020, a ser publicado pela ISDA e com entrada em vigor em 25 de janeiro de 2021 (o **Suplemento de Fallbacks de IBORs**), e (ii) com relação a um Documento Abrangido pelo Protocolo que de outra forma faça referência a uma IBOR Pertinente, incluir nos termos desse novo Documento Abrangido pelo Protocolo novos fallbacks para essa IBOR Pertinente.

Assim, uma parte pode aderir a este Protocolo e ser vinculada aos seus termos, preenchendo e entregando uma carta substancialmente no modelo do Anexo 1 a este Protocolo (uma **Carta de Adesão**) à ISDA, na qualidade de agente, conforme descrito abaixo (cada uma dessas partes, uma **Parte Aderente**).

Esta versão em português do Protocolo de Fallbacks de IBORs de 2020 da ISDA e das Alterações às Definições da ISDA de 2006 para incluir novos fallbacks de IBOR, Suplemento nº 70 às Definições da ISDA de 2006, tem como base a versão em inglês do Protocolo de Fallbacks de IBORs de 2020 da ISDA e das Alterações às Definições da ISDA de 2006 para incluir novos fallbacks de IBOR, Suplemento nº 70 às Definições da ISDA de 2006, cujos direitos autorais © 2020 são reservados à International Swaps and Derivatives Association, Inc., sendo o uso e reprodução das disposições contidas nos referidos instrumentos ser realizados mediante sua permissão. O respectivo Protocolo de Fallbacks de IBORs de 2020 da ISDA e as Alterações às Definições da ISDA de 2006 para incluir novos fallbacks de IBOR, Suplemento nº 70 às Definições da ISDA de 2006, podem ser baixados por meio de download em: <https://www.isda.org/protocol/isda-2020-ibor-fallbacks-protocol/>. A ISDA, cuja marca registrada é "ISDA®," não é afiliada da Associação e não participou na elaboração deste documento. A ISDA não está manifestando qualquer posicionamento nem prestando qualquer declaração ou garantia, expressa ou implícita, quanto à conveniência da utilização deste instrumento em qualquer operação específica, não tendo responsabilidade de qualquer natureza, quer em decorrência de ilícito civil ou contratual, por qualquer uso do documento. Os usuários devem consultar o seu assessor jurídico para determinar se este instrumento é adequado para o uso pretendido.

¹ ISDA é uma marca registrada da International Swaps and Derivatives Association, Inc. Toda a menção a ISDA, feita neste documento, deverá observar essa nota de rodapé.

1. Adesão ao Protocolo e sua Eficácia

(a) Ao aderir a este Protocolo na forma prevista neste parágrafo 1, cada Parte Aderente concorda, em consideração às promessas e avenças mútuas aqui contidas, que os termos de cada Documento Abrangido pelo Protocolo entre a Parte Aderente e qualquer outra Parte Aderente serão alterados de acordo com os termos e sujeitos às condições previstas no Anexo a este instrumento.

(b) A adesão a este Protocolo será comprovada pela assinatura e entrega on-line, de acordo com este parágrafo, à ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com os subparágrafos 1(b)(i) a 1(b)(iii) abaixo). A ISDA terá o direito, em seu exclusivo e absoluto critério de, mediante um aviso prévio de pelo menos trinta dias consecutivos na seção “*Isda 2020 IBOR Fallbacks Protocol*” (Protocolo de Fallbacks de IBORs de 2020 da ISDA) de seu website em www.isda.org (ou por outros meios adequados), designar uma data de encerramento deste Protocolo (a data de encerramento, a Data Limite). Após a Data Limite, a ISDA não aceitará mais Cartas de Adesão a este Protocolo.

(i) Cada Parte Aderente deverá acessar a seção “*Protocols*” (Protocolos) do website da ISDA em www.isda.org para inserir informações on-line necessárias para gerar seu modelo de Carta de Adesão e deverá realizar o pagamento de qualquer taxa aplicável. Baixando diretamente a Carta de Adesão preenchida do sistema de Protocolos ou mediante o recebimento via e-mail da Carta de Adesão preenchida, cada Parte Aderente assinará e fará o *upload* da Carta de Adesão assinada como um anexo PDF (formato de documento portátil) no sistema do Protocolo. Uma vez que a Carta de Adesão assinada tiver sido aprovada e aceita pela ISDA, a Parte Aderente receberá uma confirmação por e-mail da adesão da Parte Aderente a este Protocolo.

(ii) Uma cópia autenticada de cada Carta de Adesão contendo, no lugar de cada assinatura, o nome por extenso ou digitado de cada signatário será publicada pela ISDA para que possa ser visualizada por todas as Partes Aderentes. Cada Parte Aderente concorda que, para fins de comprovação, uma cópia autenticada de uma Carta de Adesão certificada pelo Diretor Jurídico (ou outro diretor apropriado) da ISDA será considerada como uma versão original.

(iii) Cada Parte Aderente concorda que a determinação da data e hora de aceitação de qualquer Carta de Adesão será determinada pela ISDA, a seu exclusivo critério. Qualquer Carta de Adesão datada e entregue à ISDA antes da

data em que este Protocolo for publicado será considerada entregue na data em que este Protocolo for publicado.

(c) Com respeito a duas Partes Aderentes, o contrato que realizar as alterações contempladas por este Protocolo, em conformidade com os termos e condições previstos neste Protocolo, entrará em vigor na Data de Implementação e referido contrato fará parte de cada Documento Abrangido pelo Protocolo a partir da Data de Implementação ou da Data do Documento Abrangido pelo Protocolo relacionado, o que ocorrer por último. As alterações previstas neste Protocolo serão realizadas na (i) Data de Implementação ou (ii) Data de Entrada em Vigor do Protocolo, o que ocorrer por último.

(A) A **Data de Entrada em Vigor do Protocolo**, com relação a um Documento Abrangido pelo Protocolo, será 25 de janeiro de 2021.

(B) A **Data de Implementação**, com relação a quaisquer duas Partes Aderentes, será a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir ao Protocolo, exceto que:

(I) com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo que um Agente tenha celebrado em nome de um Cliente, sujeito ao parágrafo 3(m) abaixo, a Data de Implementação será a data especificada no subparágrafo 3(g)(i)(A), subparágrafo 3(g)(i)(B), subparágrafo 3(g)(i)(C), parágrafo 3(h), parágrafo 3(i) ou parágrafo 3(j) abaixo, conforme aplicável; e

(II) com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente, sujeito ao parágrafo 3(m) abaixo, a Data de Implementação será o dia especificado no parágrafo 3(l) abaixo.

A aceitação pela ISDA de uma Carta de Adesão subsequente ou revisada da Parte Aderente não terá o efeito de alterar a Data de Implementação.

(d) Este Protocolo é destinado a ser utilizado sem negociação, mas sem prejudicar qualquer alteração, modificação ou renúncia com relação a um Documento Abrangido pelo Protocolo que as partes possam de outra forma firmar, de acordo com os termos desse Documento Abrangido pelo Protocolo.

(i) Ao aderir a este Protocolo, uma Parte Aderente não poderá especificar disposições, condições ou limitações adicionais em sua Carta de Adesão.

(ii) Qualquer adesão que a ISDA, na qualidade de agente, determinar, de boa-fé, que não está em conformidade com este Protocolo será anulada, e a ISDA informará a parte relevante sobre tal fato o mais rapidamente possível após tal determinação.

(e) Cada Parte Aderente reconhece e concorda que a adesão a este Protocolo é irrevogável, exceto que uma Parte Aderente poderá, após a Data de Entrada em Vigor do Protocolo, entregar à ISDA, na qualidade de agente, um aviso substancialmente no modelo do Apenso 2 a este Protocolo que estiver em vigor (determinado nos termos do parágrafo 3(f) abaixo) em qualquer Dia Útil do Protocolo (um **Aviso de Revogação**) para designar a próxima Data de Revogação como a última data em que uma Data de Implementação pode ocorrer com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo entre a contraparte e referida Parte Aderente.

(i) Após a entrega efetiva de um Aviso de Revogação por uma Parte Aderente, este Protocolo não alterará nenhum Documento Abrangido pelo Protocolo entre essa Parte Aderente e outra Parte Aderente para a qual a Data de Implementação ocorreria após a Data de Revogação relacionada.

(ii) Se um Agente aderir a este Protocolo em nome de um Cliente, então, se o Cliente entregar um Aviso de Revogação, de acordo com este parágrafo 1(e), este Protocolo não alterará nenhum Documento Abrangido pelo Protocolo entre outra Parte Aderente e tal Cliente celebrado por esse Cliente ou pelo próprio Agente (em nome desse Cliente) ou de qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente (se aplicável), em cada caso, para o qual a Data de Implementação ocorreria após a Data de Revogação designada no Aviso de Revogação do Cliente como a última data em que uma Data de Implementação pode ocorrer.

(iii) Se um Agente entregar um Aviso de Revogação de acordo com este parágrafo 1(e) em nome de um Cliente e o Cliente aderir separadamente a este Protocolo (e não por meio da intermediação de um Agente), então o Aviso de Revogação entregue pelo Agente não impedirá que uma Data de Implementação ocorra após a Data de Revogação com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo que o Cliente tenha celebrado com outra Parte Aderente (inclusive por meio do Agente).

(iv) O subparágrafo 1(e)(i), o subparágrafo 1(e)(ii) e o subparágrafo 1(e)(iii) não afetam qualquer alteração efetuada de acordo com este Protocolo a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo entre duas Partes Aderentes para o qual a

Data de Implementação ocorreu no ou antes do dia em que a Data de Revogação ocorrer ou for considerada como ocorrida, independentemente da data de celebração do Documento Abrangido pelo Protocolo, e qualquer tal alteração será vigente, independentemente da ocorrência de tal Data de Revogação.

(v) Cada Aviso de Revogação deve ser entregue pelos meios especificados no parágrafo 3(f) abaixo.

(vi) Cada Parte Aderente concorda que, para fins de comprovação, uma cópia autenticada de um Aviso de Revogação certificada pelo Diretor Jurídico (ou outro diretor apropriado) da ISDA será considerada uma versão original.

(vii) Qualquer revogação que a ISDA, na qualidade de agente, determinar, de boa-fé, que não está em conformidade com este parágrafo 1(e) será anulada, e a ISDA informará a parte relevante tal fato o mais rapidamente possível após tal determinação.

2. Declarações e Compromissos

(a) A partir do que ocorrer por último entre (i) a data em que uma Parte Aderente aderir a este Protocolo, de acordo com o parágrafo 1 acima (que será a data de aceitação pela ISDA de uma Carta de Adesão daquela Parte Aderente (de acordo com o parágrafo 1(b) acima)), e (ii) a Data do Documento Abrangido pelo Protocolo, a Parte Aderente declara à outra Parte Aderente com a qual celebrou um Documento Abrangido pelo Protocolo (essas declarações serão consideradas repetidas na Data de Entrada em Vigor do Protocolo e na Data de Implementação, se uma ou ambas as datas forem posteriores à data em que a Parte Aderente aderir a este Protocolo) cada uma das seguintes questões:

(a) **Situação.** Encontra-se, se aplicável, devidamente constituída e em pleno funcionamento ao amparo das leis da jurisdição de sua constituição ou incorporação e, se aplicável, de acordo com tais leis, gozando de boa reputação (*good standing*) ou, se declarar de outra forma sua situação no ou de acordo com o Documento Abrangido pelo Protocolo, em referida situação.

(B) **Poderes.** Tem poderes para firmar e entregar a Carta de Adesão, cumprir suas obrigações, nos termos da Carta de Adesão e do Documento Abrangido pelo Protocolo, conforme alterado pela Carta de Adesão e por este Protocolo (incluindo o Anexo ao presente instrumento), e adotou todas as medidas necessárias para autorizar a assinatura, entrega e cumprimento da Carta de Adesão.

(C) **Inexistência de Violação ou Conflito.** A assinatura, entrega e cumprimento da Carta de Adesão não viola e nem entra em conflito com, nem violará ou entrará em conflito com, qualquer lei aplicável a si, qualquer disposição de seus documentos constitutivos, qualquer decisão ou sentença de qualquer tribunal ou outra autoridade governamental aplicável a elas ou qualquer um de seus ativos ou qualquer restrição contratual vinculante ou que afete a si ou seus ativos.

(D) **Consentimentos.** Todos os consentimentos, incluindo governamentais, que precisavam ter sido obtidos por si com relação à Carta de Adesão e ao Documento Abrangido pelo Protocolo, conforme alterado pela Carta de Adesão e este Protocolo (incluindo o Anexo ao presente instrumento), foram obtidos e estão em pleno efeito e vigor, e todas as condições relacionadas a referidos consentimentos foram atendidas.

(E) **Obrigações Vinculantes.** Suas obrigações nos termos da Carta de Adesão e do Documento Abrangido pelo Protocolo, conforme alterado pela Carta de Adesão e este Protocolo (incluindo o Anexo ao presente instrumento), constituem obrigações legais, válidas e vinculativas, exequíveis de acordo com seus respectivos termos (sujeitos à falência, reestruturação, insolvência, moratória ou leis semelhantes que afetam os direitos dos credores em geral e sujeitos, quanto à aplicabilidade, aos princípios de equidade da aplicação geral (independentemente de a aplicação da execução ser obtida por um processo de equidade ou por força da lei)).

(F) **Garantia.** Sua adesão a este Protocolo e qualquer alteração contemplada por este Protocolo (incluindo o Anexo ao presente instrumento) não afetará negativamente, por si só, a aplicabilidade, eficácia ou validade de quaisquer obrigações devidas, seja por si ou por terceiros, nos termos de qualquer Documento de Garantia ou Documento de Garantia de Terceiros, com relação a suas obrigações relativas a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo, conforme alterado pela Carta de Adesão e por este Protocolo (incluindo o Anexo ao presente instrumento).

(b) Cada Parte Aderente concorda com a outra Parte Aderente com a qual celebrou um Documento Abrangido pelo Protocolo que cada uma das declarações anteriores será considerada, no caso de um Documento Abrangido pelo Protocolo que é um Contrato Principal da ISDA, uma declaração para fins da Cláusula 5(a)(iv) e, no caso de qualquer outro Documento Abrangido pelo Protocolo, uma declaração para fins de quaisquer

disposições análogas de cada um desses Documentos Abrangidos pelo Protocolo, que é feita por cada Parte Aderente a partir do que ocorrer por último entre (i) a data em que a Parte Aderente aderir a este Protocolo, de acordo com o parágrafo 1 acima, e (ii) a Data do Documento Abrangido pelo Protocolo e que é considerada repetida na Data de Entrada em Vigor do Protocolo e na Data de Implementação, caso uma ou ambas as datas forem posteriores à data em que a Parte Aderente aderir a este Protocolo.

(c) **Compromissos relacionados a Documentos Abrangidos pelo Protocolo com Documentos de Garantia de Terceiros.** Com relação aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo com Documentos de Garantia de Terceiros que requerem expressamente a obtenção do consentimento, aprovação, acordo, autorização ou outra ação de terceiros, cada Parte Aderente cujas obrigações nos termos desses contratos são garantidas pelo Terceiro se compromete, perante a outra Parte Aderente com a qual celebrou esses contratos, a ter obtido o consentimento (inclusive por meio do parágrafo 2(d) abaixo), aprovação, acordo, autorização ou outra ação do Terceiro e que irá, mediante pedido, fornecer evidência da obtenção de tal consentimento, aprovação, acordo, autorização ou outra ação para a outra Parte Aderente.

(d) **Consentimento de Terceiros.** Considera-se que cada Parte Aderente que também é um Terceiro, com relação a um Documento de Garantia de Terceiros, consentiu com as alterações impostas por este Protocolo no Documento Abrangido pelo Protocolo apoiado por esse Documento de Garantia de Terceiros.

3. Disposições Diversas

(a) **Íntegra do Contrato; Consolidação; Subsistência.**

(i) Este Protocolo constitui o acordo e entendimento integrais das Partes Aderentes com relação ao seu objeto e substitui todas as comunicações verbais e escritas prévias (exceto se de outro modo previsto neste instrumento) a esse respeito. Cada Parte Aderente reconhece que, ao aderir a este Protocolo, não se baseou em qualquer declaração verbal ou escrita, ou outra garantia (salvo segundo previsto ou mencionado em outros lugares deste Protocolo ou no Anexo) e renuncia a todos os direitos e recursos que possam estar disponíveis a ele em relação a tais declarações ou garantias, exceto que nada neste Protocolo limitará ou excluirá qualquer responsabilidade de uma Parte Aderente por fraude.

(ii) Exceto por qualquer alteração considerada feita nos termos deste Protocolo, com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo, todos os termos e condições de cada Documento Abrangido pelo Protocolo continuarão em pleno vigor e efeito, de acordo com suas disposições, conforme em vigor imediatamente

antes da data em que se tornou sujeito a este Protocolo. Salvo se expressamente declarado neste Protocolo, nada aqui constituirá uma renúncia ou liberação de quaisquer direitos de qualquer (a) Parte Aderente, nos termos de qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo ao qual a Parte Aderente faça parte, (b) garantidor ou (b) beneficiário de garantia. Este Protocolo subsistirá com relação ao seu objeto, e quaisquer alterações feitas ou consideradas como feitas de acordo com este Protocolo farão parte de cada Documento Abrangido pelo Protocolo entre as Partes Aderentes, independentemente de quaisquer declarações em um Documento Abrangido pelo Protocolo no sentido de que o Documento Abrangido pelo Protocolo constitui todo o acordo e entendimento entre as partes do Documento Abrangido pelo Protocolo com relação ao objeto do Documento Abrangido pelo Protocolo.

(b) **Exclusão de Contratos.** Sem prejuízo do disposto no parágrafo 1(a) acima, no que diz respeito a qualquer contrato entre as Partes Aderentes, se as partes desse contrato declararam expressamente em tal contrato ou concordaram por escrito que este Protocolo não se aplicará àquele contrato, então tal contrato não será um Documento Abrangido pelo Protocolo.

(c) **Alterações.** Uma alteração, modificação ou renúncia com relação às questões previstas neste Protocolo (incluindo, para evitar dúvidas, qualquer alteração, modificação ou renúncia relativa ao alinhamento de um Documento Abrangido pelo Protocolo com um instrumento ao qual o Documento Abrangido pelo Protocolo se destina a servir como proteção (hedge) (ou *vice-versa*) só será válido com relação a um Documento Abrangido pelo Protocolo caso tal alteração, modificação ou renúncia seja feita de acordo com os termos do Documento Abrangido pelo Protocolo e, então, será válido apenas entre as partes daquele Documento Abrangido pelo Protocolo.

(d) **Títulos.** Os títulos utilizados no presente Protocolo e qualquer Carta de Adesão são apenas para fins de referência e não devem afetar a interpretação nem ser levados em consideração na interpretação deste Protocolo ou qualquer Carta de Adesão.

(e) **Lei Aplicável.** Este Protocolo e cada Carta de Adesão, com relação a duas Partes Aderentes e a cada Documento Abrangido pelo Protocolo, serão regidos e interpretados de acordo com as leis da Inglaterra e do País de Gales, sem referência ao princípio de escolha de lei, desde que as alterações a cada Documento Abrangido pelo Protocolo sejam regidas e interpretadas de acordo com a lei especificada para reger esse Documento Abrangido pelo Protocolo e de acordo com o princípio de escolha de lei.

(f) **Avisos.** Qualquer Aviso de Revogação deve ser feito por escrito e enviado como um anexo PDF (formato de documento portátil) bloqueado por meio de um e-mail para

a ISDA em isda@isda.org e será considerado entregue na data em que for entregue, a menos que, na data dessa entrega, o escritório da ISDA em Londres esteja fechado, ou que a comunicação seja entregue após 17h00, horário de Londres. Nesse caso, a comunicação será considerada entregue no próximo dia em que o escritório da ISDA em Londres estiver aberto.

(g) **Capacidade de um Agente Aderir ao Protocolo em Nome de um Cliente.**

(i) Um Agente poderá aderir a este Protocolo:

(A) em nome de todos os Clientes representados por tal Agente (nesse caso, o Agente não precisa identificar cada Cliente por meio de uma plataforma on-line disponível em geral para o setor, incluindo, por exemplo, a plataforma ISDA Amend fornecida pela IHS Markit (uma **Plataforma**) e, com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo que o Agente celebrou em nome desses Clientes, a Data de Implementação será a data de aceitação pela ISDA de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir ao Protocolo);

(B) em nome apenas daqueles Clientes representados por esse Agente que esse Agente identificar especificamente por meio de uma Plataforma, e, com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo no qual o Agente tiver celebrado em nome de qualquer Cliente, a Data de Implementação será a data mostrada na Plataforma como a data em que o Agente comunicar o nome de tal Cliente à outra Parte Aderente (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão da outra Parte Aderente); ou

(C) em nome de todos os Clientes representados pelo Agente, excluindo quaisquer Clientes que o Agente identificar e comunicar à outra Parte Aderente por meio de uma Plataforma como um Cliente excluído da adesão, sujeito ao subparágrafo 3(h)(i) abaixo, na ou antes da data de aceitação pela ISDA de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir (nesse caso, o Agente não precisa identificar cada Cliente em cujo nome ele adere ao Protocolo por meio de uma Plataforma). Com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo que o Agente tiver celebrado em nome de qualquer Cliente que não tiver sido identificado e comunicado à outra Parte Aderente, por meio de uma Plataforma, como um Cliente excluído da adesão, a Data de Implementação (sujeita ao subparágrafo 3(h)(i) abaixo) será a data de

aceitação pela ISDA de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir ao Protocolo. Se o Agente não tiver comunicado o nome de quaisquer Clientes excluídos da adesão à outra Parte Aderente por meio de uma Plataforma na ou antes da data de aceitação pela ISDA de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir, então (sujeita ao subparágrafo 3(h)(i) abaixo) com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo em que o Agente tiver celebrado em nome de qualquer Cliente, a Data de Implementação será a data de aceitação pela ISDA de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir ao Protocolo

e, em cada caso, caso o Agente optar pela Opção 2 em sua Carta de Adesão, em nome daqueles Clientes cujo nome o Agente comunicar à outra Parte Aderente por meio de uma Plataforma como sendo um Cliente sujeito ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) abaixo (nesse caso, a Data de Implementação, com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente será conforme especificado no subparágrafo 3(l) abaixo).

(ii) Em cada caso, o Agente pode optar por aplicar as alterações neste Protocolo:

(A) com relação a todos os Clientes em cujo nome o Agente aderir, de acordo com o subparágrafo 3(g)(i)(A), subparágrafo 3(g)(i)(B) ou subparágrafo 3(g)(i)(C) acima, a cada Documento Abrangido pelo Protocolo que o Agente tiver celebrado em nome desses Clientes (**Opção 1**); ou

(B) (I) com relação a todos os Clientes em cujo nome o Agente aderir, de acordo com o subparágrafo 3(g)(i)(A), subparágrafo 3(g)(i)(B) ou subparágrafo 3(g)(i)(C) acima, a cada Documento Abrangido pelo Protocolo que o Agente tiver celebrado em nome desses Clientes; e (II) com relação aos Clientes em cujo nome o Agente aderir e cujos nomes o Agente comunicar à outra Parte Aderente, por meio de uma Plataforma, como sendo um Cliente sujeito ao disposto neste subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II), a cada Documento Abrangido pelo Protocolo que o Agente não celebrou em nome desses Clientes, mas que o Agente tem poderes necessários para modificar (para efeito deste Protocolo, documentos descritos neste subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) sendo **Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente** e a data mostrada na Plataforma como a data em que o Agente comunicar o nome do Cliente para a outra Parte Aderente para fins deste subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) sendo a **Data de Identificação**) (Opção 2).

Se um Agente aderir a este Protocolo e optar pela Opção 2, com relação a qualquer Cliente em cujo nome o Agente aderir, de acordo com o subparágrafo 3(g)(i)(A), subparágrafo 3(g)(i)(B) ou subparágrafo 3(g)(i)(C) acima, e cujo nome for comunicado à outra Parte Aderente como sendo um Cliente sujeito ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(B)(II), os Documentos Abrangidos pelo Protocolo mencionados no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(I) e no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) acima serão alterados de acordo com os termos deste Protocolo. Para evitar dúvidas, qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo que o Agente não celebrou em nome de um Cliente e que o Agente não tem poderes necessário modificar em nome do Cliente não constituirá um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente.

(iii) A eleição da Opção 1 ou Opção 2 será feita na Carta de Adesão. A adesão do Agente só será válida com relação aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo descritos na Opção 1 ou Opção 2, conforme aplicável, e conforme eleita na Carta de Adesão (sujeita, se o Agente optar pela Opção 2 e com relação aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente, (A) ao subparágrafo 3(g)(iv) e parágrafo 3(l) abaixo, e (B) à comunicação, pelo Agente, do nome desses Clientes em nome dos quais está alterando os Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente para a outra Parte Aderente, de acordo com o subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) acima (independentemente de o Agente aderir a este Protocolo usando a abordagem descrita no subparágrafo 3(g)(i)(A), subparágrafo 3(g)(i)(B) ou subparágrafo 3(g)(i)(C) acima)).

(iv) Se um Agente aderir a este Protocolo e eleger a Opção 2 em sua Carta de Adesão, então, com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente, o Agente deverá, assim que possível, após uma solicitação por escrito (inclusive por e-mail) da outra Parte Aderente, e, em qualquer caso, até o término do décimo quinto dia consecutivo após a solicitação, fornecer evidências satisfatórias que a outra Parte Aderente, a seu exclusivo critério, considerar necessária para comprovar os poderes do Agente para modificar esses documentos, desde que:

(A) caso, antes da data de aceitação, pela ISDA, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última parte a aderir (seja o Agente ou a outra Parte Aderente), o Agente tiver entregado à outra Parte Aderente uma cópia ou extratos relevantes do contrato (como um contrato de gestão de investimentos), nos termos do qual o Cliente em questão nomear o Agente para atuar em seu nome e autorizar o Agente a fazer as modificações contempladas por este Protocolo ao Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente (independentemente de tal

autorização mencionar este Protocolo de forma expressa ou não), então – sujeito ao direito de a outra Parte Aderente solicitar (cuja solicitação deve estar por escrito (que inclui por e-mail)) uma cópia adicional desse contrato ou dos extratos relevantes (cuja solicitação deverá ser feita até o término do décimo quinto dia consecutivo após a Data de Identificação ou a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão dessa outra Parte Aderente, o que ocorrer por último) – o Agente não precisará fornecer evidências adicionais que comprovem seus poderes modificar tal Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente em nome do Cliente em questão para os fins deste Protocolo e, com relação a esse Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente, será considerado que o Agente forneceu evidências satisfatórias à outra Parte Aderente, (I) no término do décimo quinto dia consecutivo após a Data de Identificação ou a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão dessa outra Parte Aderente, o que ocorrer por último, caso a outra Parte Aderente não solicitar uma cópia adicional desse contrato ou desses extratos relevantes, ou (II) no dia em que essa cópia adicional for entregue à outra Parte Aderente, caso a outra Parte Aderente solicitar uma cópia adicional desse contrato ou desses extratos relevantes;

(B) caso a outra Parte Aderente não solicitar essas provas até o término do décimo quinto dia consecutivo após a data de identificação ou a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão dessa outra Parte Aderente, o que ocorrer por último, então será considerado que o Agente forneceu evidências satisfatórias à outra Parte Aderente no término de tal décimo quinto dia consecutivo;

(C) sujeito ao subparágrafo 3(g)(iv)(A) acima, após a entrega de qualquer evidência do Agente à outra Parte Aderente, a menos que a outra Parte Aderente notifique o Agente em contrário até o término do décimo quinto dia consecutivo após o dia em que essas provas forem entregues, será considerado que o Agente forneceu evidências satisfatórias à outra Parte Aderente no término desse décimo quinto dia consecutivo;

(D) Se:

(I) após solicitação por escrito da outra Parte Aderente, o Agente não fornecer à outra Parte Aderente, até o término do décimo quinto dia consecutivo após uma solicitação escrita, qualquer evidência que comprove poderes para modificartais documentos, ou se o

subparágrafo 3(g)(iv)(A) acima se aplicar, uma cópia adicional do contrato ou extratos relevantes; ou

(II) sujeita ao subparágrafo 3(g)(iv)(A) acima, a outra Parte Aderente determinar que as evidências fornecidas pelo Agente não são satisfatórias e notificar o Agente até o término do décimo quinto dia consecutivo após o dia em que essas provas forem entregues,

então, sem prejuízo ao direito da outra Parte Aderente de apresentar uma nova solicitação de evidências e o direito do Agente de fornecer tais evidências, e, com relação a essas evidências, sujeito ao subparágrafo 3(g)(iv)(C) acima, o Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente não seja modificado por este Protocolo; e

(E) qualquer falha do Agente em fornecer à outra Parte Aderente essas evidências não ensejará um Evento de Inadimplemento Potencial ou a um Evento de Inadimplemento (conforme definidos no Contrato Principal da ISDA), ou a qualquer evento semelhante, nos termos do Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente em questão, ou a outro direito contratual de ação, nos termos deste Protocolo ou Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente em questão.

(v) Se um Agente aderir a este Protocolo e identificar especificamente um ou mais Clientes (A) em cujo nome estiver aderindo (conforme contemplado no subparágrafo 3(g)(i)(B) acima), (B) excluídos da adesão (conforme contemplado no subparágrafo 3(g)(i)(C) acima) e/ou (C) em cujo nome estiver alterando Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente (conforme contemplado no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) acima), conforme aplicável, por meio de uma Plataforma, tal Agente deverá fornecer o identificador de pessoa jurídica (LEI) de cada um desses Clientes por meio dessa Plataforma.

(vi) Se um Agente aderir a este Protocolo em nome de um Cliente celebrando e entregando uma Carta de Adesão em nome de tal Cliente (de acordo com o parágrafo 1 acima e este parágrafo 3(g)), as referências à Parte Aderente para fins deste Protocolo (incluindo o Anexo ao presente instrumento) e à Carta de Adesão serão interpretadas como referências a esse Cliente. Se, com relação a um Cliente, mais de uma Carta de Adesão for aceita pela ISDA, de acordo com o parágrafo 1(b) acima (em decorrência da adesão direta pelo Cliente e um ou mais Agentes também adiram ao Protocolo em nome desse Cliente), então:

(A) se a ISDA aceitar uma Carta de Adesão de um Agente em nome de um Cliente depois de ter aceitado uma Carta de Adesão daquele Cliente, qualquer documento celebrado por:

(I) esse Agente agindo em nome desse Cliente; ou

(II) se o Agente optar pela Opção 2 em sua Carta de Adesão, tal Cliente agindo em nome próprio, mas que o Agente tem poderes para modificar em nome do Cliente,

em cada caso, que tenha uma Data do Documento Abrangido pelo Protocolo anterior:

(1) à Data de Entrada em Vigor do Protocolo; ou

(2) se posteriormente, à data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão daquele Agente (ou, se posteriormente, à data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão da outra Parte Aderente),

será considerado como tendo “uma Data do Documento Abrangido pelo Protocolo antes da Data de Entrada em Vigor do Protocolo (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir ao Protocolo)” para fins das definições de Confirmação Abrangida pelo Protocolo, Documento de Garantia Abrangido pelo Protocolo e Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo listadas abaixo; e

(B) se a ISDA aceitar uma Carta de Adesão de um Cliente depois de ter aceitado uma Carta de Adesão de um Agente em nome desse Cliente, qualquer documento celebrado pelo Cliente, seja diretamente ou representado por um Agente, que tiver uma Data do Documento Abrangido pelo Protocolo anterior:

(I) à Data de Entrada em Vigor do Protocolo; ou

(II) se posteriormente, à data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão daquele Cliente (ou, se posteriormente, à data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão da outra Parte Aderente),

será considerado como tendo “uma Data do Documento Abrangido pelo Protocolo antes da Data de Entrada em Vigor do Protocolo (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última das duas Partes Aderentes a aderir ao Protocolo)” para fins das definições de Confirmação Abrangida pelo Protocolo, Documento de Garantia Abrangido pelo Protocolo e Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo listadas abaixo.

(vii) Se um Agente aderir a este Protocolo em nome de um Cliente, então, a partir do que ocorrer por último entre (A) a data em que o Agente aderir a este Protocolo, de acordo com o parágrafo 1 acima, ou (B) da Data do Documento Abrangido pelo Protocolo, tal Agente declara para cada Parte Aderente (I) com a qual celebrou um Documento Abrangido pelo Protocolo em nome do Cliente, ou (II) que fizer parte de qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente (essa declaração será considerada repetida na Data de Entrada em Vigor do Protocolo e na Data de Implementação, se uma ou ambas as datas forem posteriores à data em que o Agente aderir a este Protocolo) que tal Agente tem, na Data de Implementação pertinente, todos os poderes necessários para celebrar a Carta de Adesão em nome desse Cliente. Com relação a qualquer Cliente mencionado no parágrafo 3(h), parágrafo 3(i), parágrafo 3(j) ou parágrafo 3(k) abaixo, o Agente declara que possui, na Data de Implementação pertinente, todos os poderes necessários para aplicar os termos da Carta de Adesão ao Cliente.

(h) *Cientes Adicionados a um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente após a data de aceitação, pela ISDA, de uma Carta de Adesão da última parte a aderir entre o Agente ou a outra Parte Aderente.*

(i) Sujeito ao subparágrafo 3(h)(ii) abaixo, com relação a qualquer Cliente adicionado a um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente firmado entre um Agente e uma Parte Aderente após a data de aceitação, pela ISDA, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última parte a aderir entre o Agente ou a outra Parte Aderente (um **Novo Cliente**), o Agente e a Parte Aderente concordam que os termos do Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente, com relação à Parte Aderente e qualquer Novo Cliente, estarão sujeitos às alterações efetuadas por este Protocolo e, com relação à Parte Aderente e o Novo Cliente, a Data de Implementação será a data em que o Novo Cliente será adicionado ao Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente, salvo acordo em contrário entre o Agente e a Parte Aderente (cujo acordo, se o Agente aderir a este Protocolo usando a abordagem no subparágrafo 3(g)(i)(C) acima, poderá ser obtido pelo Agente mediante

comunicação à outra Parte Aderente, por meio de uma Plataforma, de que o Novo Cliente está excluído da adesão ao Protocolo, comunicação esta feita no momento em que o Novo Cliente for adicionado ao Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente).

(ii) Se um agente aderir a este Protocolo usando a abordagem descrita no subparágrafo 3(g)(i)(B) acima e, portanto, identificar especificamente um ou mais Clientes em cujo nome estiver aderindo, então, para que os termos de um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente entre uma Parte Aderente e qualquer Novo Cliente estejam sujeitos às alterações efetuadas por este Protocolo, o Agente deverá comunicar, por meio de uma Plataforma, a identidade de cada Novo Cliente (incluindo o identificador de pessoa jurídica (LEI)) à outra Parte Aderente que fizer parte do Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente ao qual o Novo Cliente é adicionado, e, com relação à outra Parte Aderente e esse Novo Cliente, a Data de Implementação será a data mostrada na Plataforma como a data em que o Agente comunicar, por meio dessa Plataforma, a identidade desse Novo Cliente para a outra Parte Aderente.

(i) ***Clientes Adicionados à Lista de Clientes Identificados no Escopo após a data de aceitação da Carta de Adesão do Agente pela ISDA.*** Se um agente aderir a este Protocolo usando a abordagem descrita no subparágrafo 3(g)(i)(B) acima e, portanto, identificar especificamente um ou mais Clientes em cujo nome estiver aderindo, então, para fins do subparágrafo 3(g)(ii)(A) ou 3(g)(ii)(B)(I) acima, conforme aplicável, o Agente poderá identificar os Clientes adicionais em cujo nome estiver aderindo (por meio de uma Plataforma) à outra Parte Aderente após a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de sua Carta de Adesão, e, com relação àquela outra Parte Aderente e ao Cliente adicional, a Data de Implementação será a data mostrada na Plataforma como a data em que o Agente comunicar a identidade desse Cliente adicional à outra Parte Aderente por meio dessa Plataforma para esses fins (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão daquela outra Parte Aderente), a menos que o Agente e a Parte Aderente tenham acordado de outra forma.

(j) ***Clientes Removidos da Lista de Clientes Excluídos de um Agente após a data de Aceitação da Carta de Adesão do Agente pela ISDA.*** Se um Agente aderir a este Protocolo usando a abordagem descrita no subparágrafo 3(g)(i)(C) acima e, portanto, identificar especificamente um ou mais Clientes como excluídos da adesão, então, para fins do subparágrafo 3(g)(ii)(A) ou 3(g)(ii)(B)(I) acima, conforme aplicável, o Agente poderá, após a data de aceitação de sua Carta de Adesão pela ISDA, na qualidade de agente, remover um ou mais desses Clientes de sua lista de Clientes excluídos por meio de uma Plataforma, e, com relação a qualquer outra Parte Aderente e tal Cliente,

a Data de Implementação será a data mostrada na Plataforma como a data em que o Agente comunicar à outra Parte Aderente que o Cliente foi removido da lista de Clientes excluídos (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão daquela outra Parte Aderente), a menos que o Agente e a Parte Aderente tenham acordado de outra forma.

(k) **Clientes Adicionados à Lista de Clientes de um Agente com relação aos quais o subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) acima se aplica.** Se um Agente aderir a este Protocolo, eleger a Opção 2 em sua Carta de Adesão e, portanto, identificar especificamente um ou mais Clientes sujeitos ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II), então o Agente poderá identificar Clientes adicionais sujeitos ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) (por meio de uma Plataforma), após a data de aceitação de sua Carta de Adesão pela ISDA, na qualidade de agente,.

(l) **Poderes para modificar Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente.** Se um Agente aderir a este Protocolo e eleger a Opção 2 (conforme descrito no subparágrafo 3(g)(ii) acima), então, com relação a cada Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente, a Data de Implementação será o dia em que for considerado que o Agente forneceu à outra Parte Aderente evidências que comprovam os poderes do Agente para modificar o Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente, de acordo com o subparágrafo 3(g)(iv) acima, e, para efeitos do subparágrafo 3(g)(iii) acima, apenas no que diz respeito a esses Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente, a adesão do Agente será considerada válida em tal dia.

(m) **Data de Implementação se um Agente e um Cliente aderirem a este Protocolo ou se mais de um Agente aderir em nome de um Cliente.** Se um Agente aderir a este Protocolo e, com relação a um determinado Cliente e um Documento Abrangido pelo Protocolo que o Agente celebrou em nome desse Cliente ou de um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente, há, nos termos deste Protocolo, mais de uma Data de Implementação, então, sem prejuízo de qualquer disposição contrária neste Protocolo, a Data de Implementação será a primeira dessas datas a ocorrer.

(n) **Parte Aderente que é um Agente com relação a um Documento Abrangido pelo Protocolo.** Uma Parte Aderente que firmar um Documento Abrangido pelo Protocolo (incluindo um anexo ao presente instrumento) na qualidade de agente, com relação a esse Documento Abrangido pelo Protocolo, não será considerada, para fins deste Protocolo, como uma parte ao, ou como tendo celebrado o, Documento Abrangido pelo Protocolo em decorrência de ter agido como um agente com relação a esse

Documento Abrangido pelo Protocolo, exceto se previsto de outra forma em tal Documento Abrangido pelo Protocolo.

4. Definições

As referências neste Protocolo e no Anexo aos seguintes termos deverão ter os seguintes significados:

Documento Adicional de Garantia significa os documentos (que, para evitar dúvidas, serão considerados incluindo quaisquer anexos ou apêndices ao presente instrumento) listados na Parte 2 do Anexo de Documentos Adicionais a este Protocolo.

Contrato Principal Adicional significa os documentos (que, para evitar dúvidas, serão considerados incluindo quaisquer anexos ou apêndices ao presente instrumento) listados na Parte 1 do Anexo de Documentos Adicionais a este Protocolo.

Carta de Adesão possui o significado atribuído ao termo nos parágrafos introdutórios do presente instrumento.

Parte Aderente tem o significado atribuído a esse termo nos parágrafos introdutórios do presente instrumento, interpretados de acordo com o subparágrafo 3(g)(vi) acima, quando pertinente.

Agente significa uma pessoa que celebra um Documento Abrangido pelo Protocolo (ou que tem poderes para modificar, em nome de um Cliente, um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Não-Agente), assina e entrega uma Carta de Adesão com relação a este Protocolo em nome e na qualidade de agente para um ou mais Clientes. Com relação ao parágrafo 3(h) acima, o Agente também significa uma pessoa que celebra um Documento Abrangido pelo Protocolo, assina e entrega uma Carta de Adesão, de acordo com o subparágrafo 3(g)(i) acima, apenas para fins de alteração dos contratos aos quais Novos Clientes podem ser adicionados, nos termos do parágrafo 3(h) acima.

Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente significa qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo assinado pelo Agente em nome de um ou mais Clientes antes da Data de Entrada em Vigor do Protocolo (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) em relação à última parte a aderir ao Protocolo entre o Agente ou a outra Parte Aderente), incluindo qualquer acordo assinado como um acordo global por um Agente e uma Parte Aderente antes da Data de Entrada em Vigor do Protocolo (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de

agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) em relação à última parte a aderir ao Protocolo entre o Agente ou a outra Parte Aderente) que seria um Documento Abrangido pelo Protocolo, mas na ausência de qualquer Cliente sujeito a tal acordo global que seja uma Parte Aderente.

Cliente significa, com relação a um Agente, um cliente, investidor, fundo, conta e/ou outro outorgante em cujo nome o Agente atua.

Confirmação significa, com relação a uma operação, um ou mais documentos ou outras evidências trocadas entre as partes ou válidas para a finalidade de confirmar ou comprovar a operação.

Livreto de Definições da ISDA Abrangido significa cada uma das Definições da ISDA de 2006, as Definições da ISDA de 2000, as Definições de Euro da ISDA de 1998, o Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991 e as Definições da ISDA de 1991, cada uma conforme publicada pela ISDA.

Documento de Garantia significa, com relação a uma Parte Aderente e um Documento Abrangido pelo Protocolo, qualquer documento em vigor na Data de Implementação que, pelos seus termos, assegura ou garante o cumprimento de obrigações da Parte Aderente em relação a um Documento Abrangido pelo Protocolo, de tempos em tempos, quer esse documento seja especificado como tal ou não de acordo com esse documento ou de acordo com o respectivo Documento Abrangido pelo Protocolo.

Data Limite tem o significado atribuído a esse termo no parágrafo 1(b) acima.

Suplemento de Fallbacks de IBORs tem o significado atribuído a esse termo nos parágrafos introdutórios deste documento.

Data de Identificação tem o significado atribuído a esse termo no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) acima.

Data de Implementação tem o significado atribuído a esse termo no subparágrafo 1(c)(B) acima.

ISDA tem o significado atribuído a esse termo nos parágrafos introdutórios deste documento.

Documento de Garantia da ISDA significa cada um dos seguintes documentos:

- (a) Anexo de Garantia da ISDA de 1994 (Formulário Bilateral; Contratos da ISDA sujeitos apenas à Legislação de Nova York);
- (b) Anexo de Garantia da ISDA de 1995 (Formulário Bilateral - Transferência; Contratos da ISDA sujeitos à Legislação da Inglaterra);
- (c) Instrumento de Garantia da ISDA de 1995 (Formulário Bilateral - Direito Real de Garantia; Contratos da ISDA sujeitos à Legislação da Inglaterra);
- (d) Anexo de Garantia da ISDA de 1995 (Formulário Bilateral - Empréstimo e Penhor; Direito Real de Garantia sujeito à Legislação do Japão);
- (e) Anexo de Garantia da ISDA de 1995 (Formulário Bilateral - Transferência; Contrato da ISDA sujeito à Legislação da França);
- (f) Anexo de Garantia da ISDA de 1995 (Formulário Bilateral - Transferência; Contrato da ISDA sujeito à Legislação da Irlanda);
- (g) Anexo de Garantia da ISDA de 2008 (Empréstimo/Penhor Japonês);
- (h) Anexo Padrão de Garantia de 2013 (Legislação de Nova York);
- (i) Anexo Padrão de Garantia de 2013 (Legislação da Inglaterra);
- (j) Anexo Padrão de Garantia de 2014 (Legislação de Nova York – Liquidação Multimoeda);
- (k) Anexo Padrão de Garantia de 2014 (Legislação da Inglaterra – Liquidação Multimoeda);
- (l) Anexo de Garantia da ISDA de 2014 da Legislação da Coreia (Formulário Bilateral - Empréstimo e Penhor; Anexo de Garantia sujeito à Legislação da Coreia);
- (m) Anexo de Garantia de 2016 para Margem Adicional (MA) (Formulário Bilateral; Contratos da ISDA sujeitos apenas à Legislação de Nova York), incluindo qualquer formulário celebrado entre as Partes nos termos do Protocolo de Margem Adicional de 2016 da ISDA;
- (n) Anexo de Garantia de 2016 para Margem Adicional (MA) (Formulário Bilateral - Transferência; Contratos da ISDA sujeitos à Legislação da Inglaterra), incluindo

qualquer formulário celebrado entre as Partes nos termos do Protocolo de Margem Adicional de 2016 da ISDA;

(o) Anexo de Garantia de 2016 para Margem Adicional (MA) (Formulário Bilateral - Empréstimo; Contratos da ISDA sujeitos à Legislação do Japão), incluindo qualquer formulário celebrado entre as Partes nos termos do Protocolo de Margem Adicional de 2016 da ISDA;

(p) Anexo de Garantia de 2016 para Margem Adicional (MA) (Formulário Bilateral - Transferência; Contratos da ISDA sujeitos à Legislação da França); ou

(q) Anexo de Garantia de 2016 para Margem Adicional (MA) (Formulário Bilateral - Transferência; Contratos da ISDA sujeitos à Legislação da Irlanda).

Contrato Principal da ISDA significa um Contrato Principal de 2002 da ISDA, um Contrato Principal de 2002 da ISDA (legislação da França), um Contrato Principal de 2002 da ISDA (legislação da Irlanda), um Contrato Principal de 1992 da ISDA (Multimoeda – Múltiplas jurisdições), um Contrato Principal de 1992 da ISDA (Moeda Local - Jurisdição Única), um Contrato de Swap de Taxa de Juros de 1987 da ISDA ou um Contrato de Câmbio e Taxa de Juros de 1987 da ISDA, em cada caso conforme publicado pela ISDA.

Contrato Principal significa um contrato que pode ser um Contrato Principal da ISDA ou um Contrato Principal Adicional celebrado (a) por assinatura de suas partes (seja diretamente ou por meio de um Agente) ou (b) pela assinatura de uma Confirmação por suas partes (diretamente ou por meio da intermediação de um Agente), de acordo com a qual uma parte é considerada como tendo celebrado um Contrato Principal da ISDA ou um Contrato Principal Adicional com a outra parte.

Novo Cliente tem o significado atribuído a esse termo no parágrafo 3(h)(i) acima.

Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente tem o significado atribuído a esse termo no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) acima.

Plataforma tem o significado atribuído a esse termo no parágrafo 3(g)(i)(A) acima.

Protocolo tem o significado atribuído a esse termo nos parágrafos introdutórios deste documento.

Dia Útil do Protocolo significa um dia após a Data de Entrada em Vigor do Protocolo em que os bancos e os mercados de câmbio estão abertos ao público para liquidar pagamentos em Londres e Nova York.

Confirmação Abrangida pelo Protocolo significa, sujeita ao subparágrafo 3(g)(vi) acima, uma Confirmação celebrada entre duas Partes Aderentes (seja diretamente ou por meio de um Agente e, se por meio de um Agente, seja celebrada por esse Agente ou por uma pessoa em nome desse Agente) que possui uma Data do Documento Abrangido pelo Protocolo anterior à Data de Entrada em Vigor do Protocolo (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última Parte Aderente a aderir ao Protocolo) e:

(a) complementa, faz parte e está sujeita ou é regida por um Contrato Principal e incorpora um Livreto de Definições da ISDA Abrangido;

(b) complementa, faz parte e está sujeita ou é regida por um Contrato Principal e faz referência a uma IBOR Pertinente “conforme definida”, ou de outra forma prevê o significado da IBOR Pertinente atribuído, no Livreto de Definições da ISDA Abrangido (independentemente de o Livreto de Definições da ISDA Abrangido estar incorporado integralmente nessa Confirmação); e/ou

(c) complementa, faz parte e está sujeita ou é regida por um Contrato Principal e faz referência a uma IBOR Pertinente, independente da forma em que for definida.

Documento de Garantia Abrangido pelo Protocolo¹ significa, sujeito ao subparágrafo 3(g)(vi) acima, qualquer Documento de Garantia da ISDA ou Documento Adicional de Garantia que é celebrado entre duas Partes Aderentes (seja diretamente ou por meio de um Agente e, se por meio de um Agente, seja assinada por esse Agente ou por uma pessoa em nome desse Agente) que possui uma Data do Documento Abrangido pelo Protocolo anterior à Data de Entrada em Vigor do Protocolo (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última Parte Aderente a aderir ao Protocolo) e:

(a) incorpora um Livreto de Definições da ISDA Abrangido;

¹ Note que as partes de qualquer documento de garantia que for alterado pelo Protocolo devem considerar se elas precisam adotar alguma medida para reconfirmar ou retomar qualquer garantia ou, de outra forma, atender a quaisquer formalidades, de acordo com ou em conexão com o documento de garantia pertinente, como resultado da alteração feita pelo Protocolo.

(b) faz referência a uma IBOR Pertinente “conforme definida”, ou de outra forma prevê o significado da IBOR Pertinente atribuído no Livroto de Definições da ISDA Abrangido (independentemente de o Livroto de Definições da ISDA Abrangido estar incorporado integralmente nesse Documento de Garantia da ISDA ou Documento Adicional de Garantia); e/ou

(c) faz referência a uma IBOR Pertinente, independente da forma em que for definida.

Data do Documento Abrangido pelo Protocolo significa, com relação a qualquer documento, a data desse documento, conforme nele descrita, desde que (a) se esse documento tiver datas diferentes especificadas nele, uma das quais incluir uma data especificada como uma data “a partir de”, tal data será a Data do Documento Abrangido pelo Protocolo, e (b) se esse documento for uma Confirmação (que não um contrato principal de confirmação, incluindo qualquer confirmação de termos gerais relacionada), a Data do Documento Abrangido pelo Protocolo será a Data de Negociação.

Documentos Abrangidos pelo Protocolo significa as Confirmações Abrangidas pelo Protocolo, os Contratos Principais Abrangidos pelo Protocolo e os Documentos de Garantia Abrangidos pelo Protocolo, além de qualquer documentação que regule operações compensadas (incluindo quaisquer operações que sejam “Operações de Clientes” (ou em teor equivalente), nos termos de um Aditivo de Derivativos de Mercado de Balcão (OTC) Compensados pelo Cliente de 2016 da ISDA/FIA ou qualquer contrato que esteja substancialmente relacionado aos mesmos assuntos que aqueles contemplados pelo Aditivo de Derivativos de Mercado de Balcão (OTC) Compensados pelo Cliente de 2016 da ISDA/FIA entre um membro de compensação e seu cliente).

Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo significa, sujeito ao subparágrafo 3(g)(vi) acima, um Contrato Principal que é celebrado (ou considerado celebrado) entre duas Partes Aderentes (seja diretamente ou por meio de um Agente e, se por meio de um Agente, seja assinado por esse Agente ou por uma pessoa em nome desse Agente) que possui uma Data do Documento Abrangido pelo Protocolo anterior à Data de Entrada em Vigor do Protocolo (ou, se posteriormente, a data de aceitação pela ISDA, na qualidade de agente, de uma Carta de Adesão (de acordo com o parágrafo 1(b) acima) da última Parte Aderente a aderir ao Protocolo) e:

(a) incorpora um Livroto de Definições da ISDA Abrangido;

(b) faz referência a uma IBOR Pertinente “conforme definida”, ou de outra forma prevê o significado da IBOR Pertinente atribuído no Livroto de Definições da ISDA Abrangido (independentemente de o Livroto de Definições da ISDA Abrangido estar incorporado integralmente nesse Contrato Principal); e/ou

(c) faz referência a uma IBOR Pertinente, independente da forma em que for definida.

Data de Entrada em Vigor do Protocolo tem o significado atribuído a esse termo no subparágrafo 1(c)(A) acima.

IBOR Pertinente significa:

(a) LIBOR Libra Esterlina Inglesa (taxa interbancária do mercado de Londres), LIBOR Franco Suíço (taxa interbancária do mercado de Londres), LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América (taxa interbancária do mercado de Londres), LIBOR Euro (taxa interbancária do mercado de Londres), taxa interbancária de mercado em Euro, LIBOR Iene Japonês (taxa interbancária do mercado de Londres), taxa interbancária do mercado de Tóquio em Iene Japonês, taxa interbancária do mercado de Tóquio em Euroyen, taxa de juros BBSW, taxa do mercado em Dólar Canadense, taxa interbancária do mercado de Hong Kong, taxa de swap em Dólar de Cingapura e taxa de juros em Baht Tailandês; e

(b) LIBOR (taxa interbancária do mercado de Londres) sem referência ou indicação da moeda da LIBOR (taxa interbancária do mercado de Londres) pertinente (incluindo, para evitar dúvidas, a referência na Cláusula 7.3 (*Correções aos Preços Publicados*) das Definições de Commodities de 2005 da ISDA para “a taxa spot oferecida para depósitos na moeda de pagamento no mercado interbancário de Londres aproximadamente às 11h00, horário de Londres”),

em cada caso, conforme definida ou descrita (seja em inglês ou em qualquer outro idioma) no Documento Abrangido pelo Protocolo pertinente.

Data de Revogação significa, com relação a um Aviso de Revogação e uma Parte Aderente, o último Dia Útil do Protocolo do mês civil seguinte ao mês civil em que esse Aviso de Revogação for efetivamente entregue por essa Parte Aderente à ISDA.

Aviso de Revogação tem o significado atribuído a esse termo no parágrafo 1(e) acima.

Terceiros significa, com relação a um contrato garantido por um Documento de Garantia de Terceiros, qualquer parte ao Documento de Garantia de Terceiros, que não for uma das Partes Aderentes que são partes no contrato.

Documento de Garantia de Terceiros significa, com relação a uma Parte Aderente e um Documento Abrangido pelo Protocolo, qualquer Documento de Garantia que é assinado por um ou mais Terceiros (independentemente de uma Parte Aderente ser ou

não uma parte a tal documento), independentemente de o documento ser especificado ou não como um Documento de Garantia de Terceiros ou como um Documento de Garantia no próprio documento ou no Documento Abrangido pelo Protocolo.

Data de Negociação significa, com relação a uma Confirmação Abrangida pelo Protocolo (que não um contrato principal de confirmação, incluindo qualquer confirmação de termos gerais relacionada), a data em que as partes celebram a operação relacionada.

APENSO 1 ao PROTOCOLO DE FALLBACKS DE IBORs DE 2020 DA ISDA

Modelo de Carta de Adesão

[Papel Timbrado da Parte Aderente]

[Data]

International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Prezados Senhores(as),

PROTOCOLO DE FALLBACKS DE IBORs DE 2020 DA ISDA

O objetivo desta carta é confirmar nossa adesão ao Protocolo de Fallbacks de IBORs de 2020 da ISDA, conforme publicado pela International Swaps and Derivatives Association, Inc. (**ISDA**) em 23 de outubro de 2020 (o **Protocolo**). Ao enviar esta Carta de Adesão, confirmamos que somos uma **Parte Aderente** ao Protocolo. Esta carta constitui, com relação à cada Parte Aderente e a nós, uma Carta de Adesão referida no Protocolo. As definições e disposições contidas no Protocolo são incorporadas nesta Carta de Adesão, que complementarará e fará parte de cada Documento Abrangido pelo Protocolo entre nós e cada Parte Aderente.

1. **Termos Especificados para a Parte Aderente na qualidade de outorgante**

Com relação a cada Parte Aderente e a nós, reconhecemos e concordamos que as alterações no Anexo ao Protocolo se aplicam a cada Documento Abrangido pelo Protocolo ao qual somos parte, de acordo com os termos do Protocolo e desta Carta de Adesão.

2. **Nomeação de Agente e Liberação**

Por meio deste instrumento, nomeamos a ISDA como nossa agente para os fins limitados do Protocolo e, portanto, renunciamos a quaisquer direitos de reivindicar e isentamos a ISDA de quaisquer reivindicações ou ações (sejam em contrato, contravenção ou outro) decorrentes ou de qualquer forma relacionadas a esta Carta de Adesão ou à nossa adesão ao Protocolo ou quaisquer ações contempladas como sendo exigidas pela ISDA.

3. **Acordo Arbitral e Renúncia de Ação Coletiva**

Ao aderir ao Protocolo, concordamos que todas as reivindicações ou disputas decorrentes ou relacionadas à adesão ao Protocolo serão resolvidas de forma definitiva de acordo com as Regras de Arbitragem da Câmara Internacional de Comércio (as **Regras**) por três árbitros, e neste ato renunciamos a qualquer direito de ser parte de reivindicações ou disputas contra a ISDA na qualidade de representante ou membro em qualquer ação coletiva. O(s) requerente(s) (conforme definição nas Regras) deverá(ão) nomear um árbitro na “Solicitação de Instituição de Arbitragem”. O(s) requerido(s) (conforme definição nas Regras) deverá(ão) nomear um árbitro na “Resposta à Solicitação”. Os árbitros nomeados pelas duas partes terão então 30 dias para entrar em um acordo, após consultar as partes envolvidas na arbitragem, sobre o nome de um terceiro árbitro para atuar como presidente do tribunal. Caso contrário, o Tribunal da Câmara de Comércio Internacional então escolherá o terceiro árbitro (ou qualquer árbitro que o(s) requerente(s) ou o(s) requerido(s) não vier(em) a nomear de acordo com o acima disposto).

Este acordo de arbitragem não será afetado pelo Aviso de Revogação, conforme descrito no Protocolo.

4. **Pagamento**

Cada Parte Aderente ou, se a Parte Aderente for um Cliente em cujo nome um Agente aderir a este Protocolo, cada Agente que for classificado pela ISDA para fins de adesão à ISDA como “Membro Primário da ISDA”, deve pagar uma taxa única de US\$ 500 à ISDA até a data de apresentação desta Carta de Adesão. Cada Parte Aderente ou, se a Parte Aderente for um Cliente em cujo nome um Agente aderir a este Protocolo, cada Agente que não for “Membro Primário da ISDA”, não é obrigado a pagar uma taxa à ISDA caso esta Carta de Adesão seja apresentada antes da Data de Entrada em Vigor do Protocolo. Caso uma Parte Aderente ou, se a Parte Aderente for um Cliente em cujo nome um Agente aderir a este Protocolo, um Agente que não for “Membro Primário da ISDA”, enviar esta Carta de Adesão na ou após a Data de Entrada em Vigor do Protocolo, a Parte Aderente ou o Agente (conforme aplicável) deverá pagar uma taxa única de US\$ 500 à ISDA até a data de apresentação desta Carta de Adesão.

5. **Informações de Contato**

Nossas informações de contato para fins desta Carta de Adesão são:

Nome:

Nome da Empresa:

Endereço:

Telefone:

Fax:

E-mail:

Concordamos com a publicação de uma cópia autenticada desta carta pela ISDA e a divulgação do conteúdo desta carta pela ISDA.

Atenciosamente,

[PARTE ADERENTE]²

² Especificar a razão social da Parte Aderente.

Se você for um Agente, você pode assinar a Carta de Adesão usando uma das opções abaixo. Observe que, se você quiser aderir em seu nome, como outorgante, e também em nome de seus Clientes, como Agente, você deve enviar uma carta de adesão para si mesmo, como outorgante, e uma segunda carta de adesão em nome de seus Clientes, como Agente, e, nesse último caso, de acordo com uma das opções estabelecidas abaixo.

Primeiro, se você tiver poderes para aderir a este Protocolo como Agente em nome de todos os Clientes, você poderá indicar o seguinte no campo de assinaturas: “agindo em nome de [(a)] cada fundo, conta ou outro outorgante (cada um, um “Cliente”) em cujo nome celebramos ou celebraremos um Documento Abrangido pelo Protocolo e quaisquer Novos Clientes adicionados a um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente no futuro [e (b) com relação a quaisquer Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente, cada Cliente que identificarmos, por meio de uma Plataforma, como sendo um Cliente sujeito ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(b)(II) do Protocolo]”. Se o campo de assinaturas for utilizado da forma descrita acima, uma Carta de Adesão separada para cada Cliente não precisa ser enviada à ISDA e nenhum nome específico de Cliente deve ser identificado por meio de uma Plataforma (exceto se você elege a Opção 2 nesta Carta de Adesão e, nesse caso, os Clientes em cujo nome você estiver alterando Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente devem ser identificados por meio da Plataforma; você será responsável por identificar esses Clientes e fornecer suas LEIs. Se você não puder ou não desejar nomear esses Clientes, desde que você possa identificar os Clientes por meio de LEIs, você poderá identificar esses Clientes usando LEIs e não mencionar seus nomes). Se você não optar pela Opção 2 nesta Carta de Adesão, você deve excluir o texto que consta entre colchetes na página de assinaturas.

Em segundo lugar, se você aderir a este Protocolo como um agente em nome de determinados Clientes apenas identificando especificamente esses Clientes, você poderá indicar o seguinte no campo de assinaturas: “agindo em nome de [(a)] cada fundo, conta ou outro outorgante (cada um, um “Cliente”) que identificarmos, por meio de uma Plataforma, como sendo um Cliente em cujo nome celebramos ou celebraremos um Documento Abrangido pelo Protocolo e quaisquer Novos Clientes adicionados a um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente e identificados por meio de uma Plataforma como Novo Cliente [e (b) com relação a quaisquer Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente, cada Cliente que identificarmos, por meio de uma Plataforma, como sendo um Cliente sujeito ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(b)(II) do Protocolo]”. Você será responsável por identificar quaisquer Clientes em cujo nome você celebrou ou celebrará um Documento Abrangido pelo Protocolo, quaisquer Novos Clientes e quaisquer Clientes em cujo nome você modificar Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente e, em cada caso, por fornecer suas LEIs. Se você não puder ou não desejar nomear esses Clientes, então, desde que você possa identificar os Clientes por meio de LEIs, você poderá identificar esses Clientes usando LEIs e não mencionar seus nomes. Se você

Por:

Nome:
Título:

Termos Especificados para a Parte Aderente na qualidade de Agente³

A eleição da Opção 1 ou Opção 2 abaixo só deve ser feita por um Agente. Qualquer pessoa que aderir ao Protocolo e que não estiver agindo na qualidade de Agente não deve realizar a eleição abaixo.

Com relação a cada Parte Aderente e a nós, reconhecemos e concordamos que as alterações no Anexo ao Protocolo devem ser aplicadas a:

Opção 1

não optar pela Opção 2 nesta Carta de Adesão, você deve excluir o texto que consta entre colchetes na página de assinaturas.

Em terceiro lugar, se você aderir a este Protocolo como um agente em nome de determinados Clientes apenas excluindo determinados Clientes, você poderá indicar o seguinte no campo de assinaturas: “agindo em nome de [(a)] cada fundo, conta ou outro outorgante (cada um, um “Cliente”) em cujo nome celebramos ou celebraremos um Documento Abrangido pelo Protocolo (exceto aqueles Clientes que identificarmos, por meio de uma Plataforma, como excluídos da adesão) e quaisquer Novos Clientes adicionados a um Documento Abrangido pelo Protocolo Assinado por um Agente (exceto quaisquer Novos Clientes que identificarmos, por meio de uma Plataforma, como excluídos da adesão) [e (b) com relação a quaisquer Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente, cada Cliente que identificarmos, por meio de uma Plataforma, como sendo um Cliente sujeito ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(b)(II) do Protocolo]”. Você será responsável por identificar quaisquer Clientes excluídos e quaisquer Clientes em cujo nome você alterar Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente e, em cada caso, por fornecer suas LEIs. Se você não puder ou não desejar nomear os Clientes excluídos ou os Clientes em cujo nome você modificar Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente, então, desde que você possa identificá-los por meio de LEIs, você poderá identificar esses Clientes usando LEIs e não mencionar seus nomes. Se você não optar pela Opção 2 nesta Carta de Adesão, você deve excluir o texto que consta entre colchetes na página de assinaturas.

Em quarto lugar, se você aderir a este Protocolo como um agente em nome de nenhum Cliente atual, você poderá indicar o seguinte no campo de assinaturas: “agindo para alterar cada Documento Abrangido pelo Protocolo (ou outro contrato que venha a ser considerado como um Documento Abrangido pelo Protocolo) entre ele (como agente) e cada Parte Aderente, com relação a Novos Clientes”.

³ As descrições da Opção 1 e da Opção 2 nesta Carta de Adesão e de disposições relacionadas dentro do Protocolo são feitas apenas por conveniência. As Partes Aderentes devem ler as disposições do Protocolo antes de enviar uma Carta de Adesão. No caso de qualquer inconsistência entre as descrições da Opção 1 e da Opção 2 e as disposições relacionadas nesta Carta de Adesão e as disposições do Protocolo, as disposições do Protocolo prevalecerão.

- [] Documento Abrangido pelo Protocolo que celebramos em nome de um ou mais Clientes abrangidos de acordo com os termos do Protocolo e desta Carta de Adesão (conforme contemplado pela Opção 1 no Protocolo); ou

Opção 2

- [] Documento Abrangido pelo Protocolo (i) que celebramos em nome de um ou mais Clientes abrangidos de acordo com os termos do Protocolo e desta Carta de Adesão e (ii) que não celebramos em nome de um ou mais Clientes, mas que temos para modificar agindo em nome do Cliente, de acordo com e sujeitos aos termos do Protocolo e desta Carta de Adesão (conforme contemplado pela Opção 2 no Protocolo).

Concordamos, em nossa qualidade de Agente para o(s) Cliente(s) pertinente(s), em fornecer à cada Parte Aderente, assim que possível, após solicitação por escrito da Parte Aderente em questão (inclusive por e-mail) e, em qualquer caso, até o término do décimo quinto dia consecutivo após a solicitação (e conforme exigido por e de acordo com o subparágrafo 3(g)(iv) do Protocolo), evidências satisfatórias para essa outra Parte Aderente que, a exclusivo critério dessa Parte Aderente, comprove nossos poderes para modificar qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo que não celebramos em nome de um ou mais Clientes (cujo nome comunicamos à cada Parte Aderente pertinente, por meio de uma Plataforma, como sendo um Cliente sujeito ao disposto no subparágrafo 3(g)(ii)(B)(II) do Protocolo).

O não fornecimento dessas evidências a uma Parte Aderente (a menos que seja considerado que o Agente forneceu essas evidências, nos termos do subparágrafo 3(g)(iv) do Protocolo), somente no que diz respeito aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo Assinados por um Não-Agente entre o(s) Cliente(s) pertinente(s) e a Parte Aderente, resultará na nulidade desta Carta de Adesão em relação àquela Parte Aderente, a menos e até que seja considerado que nós, em nossa qualidade de Agente para o(s) Cliente(s) pertinente(s), fornecemos tais evidências à Parte Aderente pertinente, de acordo com o subparágrafo 3(g)(iv) do Protocolo. O não fornecimento dessas evidências à outra Parte Aderente não dará ensejo a um Evento de Inadimplemento Potencial ou a um Evento de Inadimplemento (conforme definidos no Contrato Principal da ISDA), ou a qualquer evento semelhante, nos termos desses Documentos Abrangidos pelo Protocolo ou a outro direito contratual de ação, nos termos deste Protocolo ou dos Documentos Abrangidos pelo Protocolo em questão.

APENSO 2 ao PROTOCOLO DE FALLBACKS DE IBORs DE 2020 DA ISDA

Modelo de Aviso de Revogação

[Papel Timbrado da Parte Aderente]

[Data]

International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Enviar para: isda@isda.org

Prezados Senhores(as),

PROTOCOLO DE FALLBACKS DE IBORs DE 2020 DA ISDA - Designação de uma Data de Revogação

O objetivo desta carta é notificá-los de que desejamos designar uma Data de Revogação como a última data em que uma Data de Implementação pode ocorrer com relação a qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo entre nós e qualquer outra Parte Aderente, de acordo com os termos do Protocolo de Fallbacks de IBORs de 2020 da ISDA, conforme publicado pela International Swaps and Derivatives Association, Inc. (**ISDA**) em 23 de outubro de 2020 (o **Protocolo**).

Esta carta constitui um Aviso de Revogação, conforme mencionado no Protocolo.

Concordamos com a publicação da cópia autenticada deste aviso pela ISDA na e após a Data de Revogação, e com a divulgação do conteúdo desta carta pela ISDA.

Atenciosamente,

[PARTE ADERENTE]⁴

⁴Especificar a razão social da Parte Aderente.

Se você for um Agente e agir em nome de vários Clientes, você pode assinar um Aviso de Revogação usando um dos métodos abaixo. Alternativamente, você pode enviar um Aviso de Revogação por Cliente.

Primeiro, se você tiver poderes para entregar um Aviso de Revogação para este Protocolo na qualidade de Agente em nome de todos os Clientes, você poderá indicar o seguinte no campo de assinaturas: “agindo em nome de cada fundo, conta ou outro outorgante (cada um, um “Cliente”) representado por nós (na qualidade de agente)” ou outra linguagem que indique os Clientes aos quais esta carta se aplica. Se o campo de assinaturas for utilizado da forma descrita acima, um Aviso de Revogação separado para

Por:

Nome:
Cargo:
Assinatura:

cada Cliente não precisa ser enviado à ISDA e nenhum nome específico de Clientes precisa ser identificado no Aviso de Revogação.

Em segundo lugar, se você tiver poderes para entregar um Aviso de Revogação para este Protocolo na qualidade de Agente em nome de determinados Clientes, você poderá indicar o seguinte no campo de assinaturas: “agindo em nome de cada fundo, conta ou outro outorgante (cada um, um “Cliente”) representado por nós (na qualidade de agente) identificado no Aviso de Revogação ou em um anexo ao presente instrumento”. Se você não quiser ou não desejar identificar esses Clientes, caso você possa identificar os Clientes revogadores por meio de identificadores específicos que serão conhecidos e reconhecidos por todas as Partes Aderentes com as quais os Clientes pertinentes celebraram Confirmações, Contratos Principais e/ou documentos de garantia, você poderá identificar esses Clientes sujeitos ao Aviso de Revogação utilizando tais identificadores específicos e sem mencionas qualquer nome.

O parágrafo 1(e) do Protocolo estabelece as consequências de um Aviso de Revogação quando um Agente adere ao Protocolo em nome de um Cliente.

ANEXO ao PROTOCOLO DE FALLBACKS DE IBORs DE 2020 DA ISDA

Anexo de Documentos Adicionais

Parte 1: Contratos Principais Adicionais

- (a) Contrato Principal de 2001 da FBF relativo a Operações em Instrumentos Financeiros Futuros.
- (b) Contrato Principal de 2007 da FBF relativo a Operações em Instrumentos Financeiros Futuros.
- (c) Contrato Principal de 2013 da FBF relativo a Operações em Instrumentos Financeiros Futuros.
- (d) Contrato Principal de 1994 da AFB para Operações de Câmbio e de Derivativos.
- (e) Contrato Principal de 1997 da AFTI/BBF para Empréstimos de Valores Mobiliários.
- (f) Contrato Principal de 2007 da AFTI/BBF para Empréstimos de Valores Mobiliários.
- (g) Contrato Principal de 2007 da FBF para Operações Compromissadas.
- (h) Contrato Principal de 1994 da AFTB para Operações Compromissadas com Entrega de Valores Mobiliários.
- (i) Anexo de Assinaturas com relação aos Contratos Principais de 1994/2001/2007/2013 da AFB/BBF.
- (j) Contrato Principal Espanhol de 1997 (*Contrato Marco de Operaciones Financieras* ou *CMOF*) publicado pela *Asociación Española de Banca* (Associação Bancária Espanhola) e *Confederación Española de Cajas de Ahorros* (Confederação Espanhola de Bancos de Poupança).
- (k) Anexo III ao Contrato Principal Espanhol de 1997 (*Contrato Marco de Operaciones Financieras* ou *CMOF*) publicado pela *Asociación Española de Banca* (Associação Bancária Espanhola) e *Confederación Española de Cajas de Ahorros* (Confederação Espanhola de Bancos de Poupança).

- (l) Contrato Principal Espanhol de 2009 (*Contrato Marco de Operaciones Financieras* ou CMOF) publicado pela *Asociación Espanola de Banca* (Associação Bancária Espanhola) e *Confederación Espanola de Cajas de Ahorros* (Confederação Espanhola de Bancos de Poupança).
- (m) Anexo III ao Contrato Principal Espanhol de 2009 (*Contrato Marco de Operaciones Financieras* ou CMOF) publicado pela *Asociación Espanola de Banca* (Associação Bancária Espanhola) e *Confederación Espanola de Cajas de Ahorros* (Confederação Espanhola de Bancos de Poupança).
- (n) Contrato Principal Espanhol de 2013 (*Contrato Marco de Operaciones Financieras* ou CMOF) publicado pela *Asociación Espanola de Banca* (Associação Bancária Espanhola) e *Confederación Espanola de Cajas de Ahorros* (Confederação Espanhola de Bancos de Poupança).
- (o) Anexo III ao Contrato Principal Espanhol de 2013 (*Contrato Marco de Operaciones Financieras* ou CMOF) publicado pela *Asociación Espanola de Banca* (Associação Bancária Espanhola) e *Confederación Espanola de Cajas de Ahorros* (Confederação Espanhola de Bancos de Poupança).
- (p) Contrato Principal Suíço de 2003 para Instrumentos de Derivativos do Mercado de Balcão (OTC) publicados pela Associação dos Banqueiros Suíços.
- (q) Contrato Principal Suíço de 2013 para Instrumentos de Derivativos do Mercado de Balcão (OTC) publicados pela Associação dos Banqueiros Suíços (para utilização relacionada a determinadas definições da ISDA).
- (r) Contrato Principal Suíço de 2013 para Instrumentos de Derivativos do Mercado de Balcão (OTC) publicados pela Associação dos Banqueiros Suíços (versão não-ISDA não para utilização relacionada a quaisquer definições da ISDA).
- (s) Contrato Principal Bilateral Suíço de 1999 Acordo para Operações Compromissadas publicadas pela Associação de Banqueiros Suíços.
- (t) Contrato Principal Multilateral Suíço de 1999 Acordo para Operações Compromissadas publicadas pela Associação de Banqueiros Suíços.
- (u) Contrato Principal Suíço de 2011 para Empréstimos de Valores Mobiliários elaborado pela Associação de Banqueiros Suíços.

- (v) Contrato Principal de 2001 para Operações Financeiras patrocinadas pela Federação Bancária da União Europeia (EBF ou FBE) em cooperação com o European Savings Banks Group (ESBG) e a Associação Europeia de Bancos Cooperativos (EACB).
- (w) Contrato Principal de 2004 para Operações Financeiras patrocinadas pela Federação Bancária da União Europeia (EBF ou FBE) em cooperação com o *European Savings Banks Group* (ESBG) e a Associação Europeia de Bancos Cooperativos (EACB).
- (x) Contrato Principal de 2020 para Operações Financeiras patrocinadas pela Federação Bancária da União Europeia (EBF ou FBE) em cooperação com o *European Savings Banks Group* (ESBG) e a Associação Europeia de Bancos Cooperativos (EACB).
- (y) Contrato Principal Austríaco para Operações Financeiras (*Österreichischer Rahmenvertrag für Finanztermingeschäfte* ou ÖRV).
- (z) Contrato Principal Internacional de Câmbio e Opções International (FEOMA) de 1997.
- (aa) Contrato Principal Internacional de Câmbio (IFEMA) de 1993.
- (bb) Contrato Principal Internacional de Câmbio (IFEMA) de 1997.
- (cc) Contrato Principal Internacional do Mercado de Opções de Moeda (ICOM) de 1997.
- (dd) Contrato Principal Internacional de Câmbio e Opções de Moeda (IFXCO) de 2005.
- (ee) Contrato Principal Global de Recompra (GMRA) de 1992 da PSA/ISMA.
- (ff) Contrato Principal Global de Recompra (GMRA) de 1995 da PSA/ISMA.
- (gg) Contrato Principal Global de Recompra (GMRA) de 2000 da TBMA/ISMA.
- (hh) Contrato Principal Global de Recompra (GMRA) de 2011 da SIFMA/ICMA.
- (ii) Contrato Principal Global de Empréstimo de Valores Mobiliários (GMSLA) de 2000 da ISLA.

- (jj) Contrato Principal Global de Empréstimo de Valores Mobiliários (GMSLA) de 2010 da ISLA.
- (kk) Contrato Principal Global de Empréstimo de Valores Mobiliários (GMSLA) de 2018 da ISLA - Direito Real sobre Garantias.
- (ll) Contrato Principal de Empréstimo de Valores Mobiliários (MSLA) de 1993 da TBMA/SIA.
- (mm) Contrato Principal de Empréstimo de Valores Mobiliários (MSLA) de 2000 da TBMA/SIA.
- (nn) Contrato Principal de Empréstimo de Valores Mobiliários (MSLA) de 2017 da SIFMA.
- (oo) Contrato Principal de Recompra (MRA) de 1987 da PSA.
- (pp) Contrato Principal de Recompra (MRA) de 1996 da TBMA.
- (qq) Contrato Principal de Opções do Mercado de Balcão (OTC) de 2000 da SIFMA.
- (rr) Contrato Principal de Corretor de 1989 da TBMA, Operação de Opções do Mercado de Balcão (OTC) - Títulos do Tesouro norte-americano.
- (ss) Contrato Principal de Emissões da LF-IETA.
- (tt) Contrato da WSPP.
- (uu) Contrato Principal de Negociação de Rede Elétrica de 2004 da FIA.
- (vv) Contrato Principal de Compra e Venda de Energia Elétrica da EEI.
- (ww) Contrato Principal EL - Contrato Principal de Energia Elétrica.
- (xx) Contrato Principal Internacional de Lingotes de 1994 da LBMA/FEC (versão da legislação da Inglaterra).
- (yy) Contrato Principal Internacional de Lingotes de 1994 da LBMA/FEC (versão da legislação de Nova York).

- (zz) Contrato Principal Australiano de Empréstimo de Valores Mobiliários de 1997 da ASLA (AMSLA).
- (aaa) Contrato Principal Australiano de Empréstimo de Valores Mobiliários de 2002 da ASLA (AMSLA).
- (bbb) Contrato Principal Australiano de Empréstimo de Valores Mobiliários de 2003 da ASLA (AMSLA).
- (ccc) Contrato Base de Curto Prazo do GISB para Compra e Venda de Gás Natural.
- (ddd) Contrato Base da NAESB para Compra e Venda de Gás Natural.
- (eee) Contrato Principal de Empréstimo de Ações da Gilt Edged (GESLA) de 1996.
- (fff) Contrato Principal de Empréstimo de Ações a Juros Fixos (MEFISLA) de 1996.
- (ggg) Contrato (de Intermediação de) Empréstimos de Ações a Juros Fixos de 1994.
- (hhh) Acordo Internacional do Doador de Valores Mobiliários (OSLA) de 1994.
- (iii) Acordo Internacional do Doador de Valores Mobiliários (OSLA) de 1995.
- (jjj) Contrato Padrão de Negociação de Carvão (SCoTA) da globalCOAL.
- (kkk) Acordo da KOFIA sobre Operações de Margem.
- (III) Acordo da KOFIA sobre Negociação de Margem de Câmbio.
- (mmm) Acordo da KOFIA sobre Empréstimos de Valores Mobiliários.
- (nnn) Acordo da KOFIA sobre Contrato de Recompra (Repo) entre Instituições.
- (ooo) Acordo da KOFIA sobre Contrato de Recompra (Repo) com Clientes.
- (ppp) Modelo de acordo em coreano de melhores práticas da KOFIA para derivativos do mercado de balcão (OTC).
- (qqq) Contrato de Operações Compromissadas e Operações Compromissadas Reversas da Organização Reguladora do Setor de Investimentos do Canadá (IIROC).

- (rrr) Contrato Principal relativo às Operações de Empréstimo de Ações (*kabuken tou taishaku torihiki ni kansuru kihon keiyakusho*) (incluindo, entre outros, contratos separados a serem firmados de acordo ou em conexão com esse Contrato Principal, como Memorando de Entendimento Suplementar (*kabuken tou taishaku torihiki ni kansuru kihon keiyakusho fuzoku oboegaki*)) publicado pela Associação de Corretores de Valores Mobiliários do Japão.
- (sss) Contrato Principal relativo às Operações de Empréstimo de Títulos Públicos (*saiken taishaku torihiki ni kansuru kihon keiyakusho*) (incluindo, entre outros, contratos separados a serem firmados de acordo ou em conexão com esse Contrato Principal, como Memorando de Entendimento Suplementar (*saiken taishaku torihiki ni kansuru kihon keiyakusho fuzoku oboegaki*)) publicado pela Associação de Corretores de Valores Mobiliários do Japão.
- (ttt) Contrato Principal relativo às Operações Compromissadas envolvendo de Recompra de Títulos Públicos (*saiken tou no gensaki taishaku torihiki ni kansuru kihon keiyakusho*) (incluindo, entre outros, contratos separados a serem firmados de acordo ou em conexão com esse Contrato Principal, como Memorando de Entendimento Suplementar (*saiken tou no gensaki taishaku torihiki ni kansuru kihon keiyakusho fuzoku oboegaki*)) publicado pela Associação de Corretores de Valores Mobiliários do Japão.
- (uuu) Contrato Principal Mexicano de Derivativos (*Contrato Marco para Operaciones Financieras Derivadas*) publicado pela *Asociación de Bancos de Mexico* (ABM) e *Asociación Mexicana de Instituciones Bursatiles* (AMIB).
- (vvv) Contrato Principal Mexicano de Compra e Venda/Recompra de Valores Mobiliários (*Contrato Marco para Operaciones de Compraventa de Valores y Reporto*) publicado pela *Asociación de Bancos de Mexico* (ABM) e *Asociación Mexicana de Instituciones Bursatiles* (AMIB).

Parte 2: Documentos Adicionais de Garantia

- (a) Anexo de Garantia da FBF de 2007.
- (b) Anexo de Garantia da ABF de 1997.
- (c) Adendo da AFB/BBF ao Anexo de Garantia da ISDA de 2016 para Margem Adicional (MA).

- (d) Apêndice de Garantia ao Contrato Principal Suíço de 2008 para Instrumentos de Derivativos do Mercado de Balcão (OTC) publicados pela Associação dos Banqueiros Suíços.
- (e) Apêndice de Garantia ao Contrato Principal Suíço de 2015 para Instrumentos de Derivativos do Mercado de Balcão (OTC) publicados pela Associação dos Banqueiros Suíços.
- (f) Apêndice de Garantia para Margem Adicional ao Contrato Principal Suíço para Instrumentos de Derivativos do Mercado de Balcão (OTC) publicados pela Associação dos Banqueiros Suíços.
- (g) Contrato Mexicano de Garantia relativo a Derivativos (*Contrato Global para Otorgar Garantías respecto de Operaciones Financieras Derivadas*) publicado pela *Asociación de Bancos de Mexico (ABM)* e *Asociación Mexicana de Instituciones Bursátiles (AMIB)*.

ANEXO
ao PROTOCOLO DE FALLBACKS DE IBORs DE 2020 DA ISDA

1. Alterações aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo que incorporam as Definições da ISDA de 2006

Se um Documento Abrangido pelo Protocolo incorporar as Definições da ISDA de 2006, a versão das Definições da ISDA de 2006 assim incorporadas será alterada de acordo com os termos do Suplemento de Fallbacks de IBORs (e, se esse Documento Abrangido pelo Protocolo for um Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, qualquer referência a um termo definido nas Definições da ISDA de 2006 em uma Confirmação que complementar, fizer parte e estiver sujeita a esse Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, será uma referência ao termo conforme definido nas Definições da ISDA de 2006, conforme alteradas de acordo com o Suplemento de Fallbacks de IBORs).

2. Alterações aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo que incorporam as Definições da ISDA de 2000

Se um Documento Abrangido pelo Protocolo incorporar as Definições da ISDA de 2000, a versão das Definições da ISDA de 2000 assim incorporadas será alterada de acordo com os termos do Suplemento de Fallbacks de IBORs (e, se esse Documento Abrangido pelo Protocolo for um Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, qualquer referência a um termo definido nas Definições da ISDA de 2000 em uma Confirmação que complementar, fizer parte e estiver sujeita a esse Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, será uma referência ao termo conforme definido nas Definições da ISDA de 2000, conforme alteradas de acordo com o Suplemento de Fallbacks de IBORs), sendo certo que o Suplemento de Fallbacks de IBORs será considerado alterado da seguinte forma:

(a) cada uma das seguintes cláusulas deverá ser excluída:

(i) **“GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;

(ii) **“CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;

(iii) **“USD-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;

(iv) **“EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;

(v) **“JPY-LIBOR-FRASET”**;

- (vi) “JPY-LIBOR-BBA-Bloomberg”;
- (vii) “JPY-TIBOR-TIBM–(All Banks)-Bloomberg”;
- (viii) “AUD-BBR-BBSW-Bloomberg”;
- (ix) “CAD-BA-CDOR-Bloomberg”; e
- (x) “HKD-HIBOR-HKAB-Bloomberg”;

(b) a cláusula intitulada “EUR-EURIBOR-Reuters” será renomeada “EUR-EURIBOR-Telerate” e as referências nessa cláusula (ou em cláusulas relacionadas) à “EUR-EURIBOR-Reuters” serão excluídas e substituídas por “EUR-EURIBOR-Telerate”;

(c) a cláusula intitulada “AUD-BBR-AUBBSW” será renomeada “AUD-BBR-ISDC” e as referências nessa cláusula (ou em cláusulas relacionadas) à “AUD-BBR-AUBBSW” serão excluídas e substituídas por “AUD-BBR-ISDC”;

(d) a cláusula intitulada “SGD-SOR-VWAP” será renomeada “SGD-SOR-Telerate” e as referências nessa cláusula (ou em cláusulas relacionadas) à “SGD-SOR-VWAP” serão excluídas e substituídas por “SGD-SOR-Telerate”;

(e) na cláusula intitulada “THB-THBFIX-Reuters”, o parágrafo intitulado “*Inexistência de Data Efetiva de Término de Índice*” será considerado alterado da seguinte forma:

(i) a frase “*“THB-THBFIX-Bancos de Referência” como a Opção de Taxa Flutuante aplicável*” será excluída e substituída pela frase “*“THB-SOR-Bancos de Referência” como a Opção de Taxa Flutuante aplicável, mas com as seguintes variações.*” e os subparágrafos (a), (b) e (c) da Cláusula 7.1(z)(iii) das Definições da ISDA de 2000 serão inseridos imediatamente depois de tal frase; e

(ii) a última frase nesse parágrafo será suprimida; e

(f) todas as referências aos números de cláusulas dentro das Definições da ISDA de 2006 serão consideradas referências às cláusulas equivalentes dentro das Definições da ISDA de 2000.

3. **Alterações aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo que incorporam as Definições da ISDA de 1991 e/ou o Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991**

Se um Documento Abrangido pelo Protocolo incorporar as Definições da ISDA de 1991 e/ou o Suplemento de 1998 às definições da ISDA de 1991, a versão das Definições da ISDA de 1991 e/ou do Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991 (conforme aplicável) assim incorporadas será alterada de acordo com os termos do Suplemento de Fallbacks de IBORs (e, se esse Documento Abrangido pelo Protocolo for um Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, qualquer referência a um termo definido nas Definições da ISDA de 1991 e/ou no Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991 em uma Confirmação que complementar, fizer parte e estiver sujeita a esse Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, será uma referência ao termo conforme definido nas Definições da ISDA de 1991 e/ou no Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991, conforme alteradas de acordo com o Suplemento de Fallbacks de IBORs), sendo certo que o Suplemento de Fallbacks de IBORs será considerado alterado da seguinte forma:

(a) se o Documento Abrangido pelo Protocolo incorporar apenas as Definições da ISDA de 1991, as Definições da ISDA de 1991 complementadas pelo Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991 ou o Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991, cada uma das seguintes cláusulas será excluída:

- (i) **“GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;
- (ii) **“CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;
- (iii) **“USD-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;
- (iv) **“EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;
- (v) **“EUR-EURIBOR-Reuters”**;
- (vi) **“JPY-LIBOR-FRASET”**;
- (vii) **“JPY-LIBOR-BBA-Bloomberg”**;
- (viii) **“JPY-TIBOR-17097”**;
- (ix) **“JPY-TIBOR-TIBM–(All Banks)-Bloomberg”**;
- (x) **“AUD-BBR-BBSW-Bloomberg”**;
- (xi) **“CAD-BA-CDOR-Bloomberg”**;

(xii) “**HKD-HIBOR-HKAB-Bloomberg**”; e

(xiii) “**THB-THBFIX-Reuters**”;

(b) se o Documento Abrangido pelo Protocolo incorporar apenas as Definições da ISDA de 1991, cada uma das seguintes cláusulas será excluída:

(i) “**JPY-TIBOR-ZTIBOR**”; e

(ii) “**SGD-SOR-VWAP**”;

(c) se o Documento Abrangido pelo Protocolo incorporar as Definições da ISDA de 1991 conforme complementadas pelo Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991 ou apenas o Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991, a cláusula intitulada “**SGD-SOR-VWAP**” será renomeada “**SGD-SOR-Telerate**” e as referências nessa cláusula (ou em cláusulas relacionadas) à “SGD-SOR-VWAP” serão excluídas e substituídas por “SGD-SOR-Telerate”;

(d) a cláusula intitulada “**EUR-LIBOR-BBA**” será renomeada “**XEU-LIBOR-BBA**” e as referências nessa cláusula (ou em cláusulas relacionadas) à “EUR-LIBOR-BBA” serão excluídas e substituídas por “XEU-LIBOR-BBA”;

(e) a cláusula intitulada “**AUD-BBR-AUBBSW**” será renomeada “**AUD-BBR-ISDC**” e as referências nessa cláusula (ou em cláusulas relacionadas) à “AUD-BBR-AUBBSW” serão excluídas e substituídas por “AUD-BBR-ISDC”; e

(f) todas as referências aos números de cláusulas dentro das Definições da ISDA de 2006 serão consideradas referências às cláusulas equivalentes dentro das Definições da ISDA de 1991 ou do Suplemento de 1998 às Definições da ISDA de 1991 (conforme aplicável).

4. Alterações aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo que incorporam as Definições de Euro da ISDA de 1998

Se um Documento Abrangido pelo Protocolo incorporar as Definições de Euro da ISDA de 1998:

(a) a versão das Definições de Euro da ISDA de 1998 assim incorporadas será alterada de acordo com os termos do Suplemento de Fallbacks de IBORs (e, se esse Documento Abrangido pelo Protocolo for um Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, qualquer referência a um termo definido nas Definições Europeias da ISDA

de 1998 em uma Confirmação que complementar, fizer parte e estiver sujeita a esse Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, será uma referência ao termo conforme definido nas Definições Europeias da ISDA de 1998, conforme alteradas de acordo com o Suplemento de Fallbacks de IBORs), sendo certo que o Suplemento de Fallbacks de IBORs será considerado alterado da seguinte forma:

(i) cada uma das seguintes cláusulas deverá ser excluída:

- (A) “GBP-LIBOR-BBA”;
- (B) “GBP-LIBOR-BBA-Bloomberg”;
- (C) “CHF-LIBOR-BBA”;
- (D) “CHF-LIBOR-BBA-Bloomberg”;
- (E) “USD-LIBOR-BBA”;
- (F) “USD-LIBOR-BBA-Bloomberg”;
- (G) “EUR-LIBOR-BBA-Bloomberg”;
- (H) “JPY-LIBOR-FRASET”;
- (I) “JPY-LIBOR-BBA”;
- (J) “JPY-LIBOR-BBA-Bloomberg”;
- (K) “JPY-TIBOR-17097”;
- (L) “JPY-TIBOR-TIBM–(All Banks)-Bloomberg”;
- (M) “JPY-TIBOR-ZTIBOR”;
- (N) “AUD-BBR-AUBBSW”;
- (O) “AUD-BBR-BBSW”;
- (P) “AUD-BBR-BBSW-Bloomberg”;
- (Q) “CAD-BA-CDOR”;

- (R) “CAD-BA-CDOR-Bloomberg”;
- (S) “HKD-HIBOR-HKAB”;
- (T) “HKD-HIBOR-HKAB-Bloomberg”;
- (U) “SGD-SOR-VWAP”; e
- (V) “THB-THBFIX-Reuters”;

(ii) a cláusula intitulada “EUR-EURIBOR-Reuters” será renomeada “EUR-EURIBOR-Telerate” e as referências nessa cláusula (ou em cláusulas relacionadas) à “EUR-EURIBOR-Reuters” serão excluídas e substituídas por “EUR-EURIBOR-Telerate”; e

(iii) todas as referências aos números de cláusulas dentro das Definições da ISDA de 2006 serão consideradas referências às cláusulas equivalentes dentro das Definições de Euro da ISDA de 1998.

(b) Se uma Taxa Relevante (conforme definida nas Definições da ISDA de 1991) for determinada de acordo com a Cláusula 4.3(b) (*Fallbacks de Fonte de Preços*) das Definições de Euro da ISDA de 1998 e “taxas para depósitos em euros” mencionadas nessa cláusula forem necessárias para qualquer determinação, mas não estiverem disponíveis, serão consideradas referências a uma IBOR Pertinente (e, em particular, à taxa interbancária em euro) à qual o parágrafo 6 deste Anexo se aplica.

5. Alterações aos Documentos Abrangidos pelo Protocolo que fazem referência a uma IBOR Pertinente “conforme definida” ou como tendo o significado atribuído em um Livro de Definições da ISDA Abrangido

Um Documento Abrangido pelo Protocolo do tipo descrito no subparágrafo (b), respectivamente, da definição de Confirmação Abrangida pelo Protocolo, Documento de Garantia Abrangido pelo Protocolo ou Contrato Principal Abrangido pelo de Protocolo, será alterado de modo que a referência à IBOR Pertinente “conforme definida”, ou a referência à IBOR Pertinente como tendo o significado atribuído, no Livro de Definições da ISDA Abrangido será, em vez disso, uma referência à Opção de Taxa pertinente no Suplemento de Fallbacks de IBORs (ou, se houver mais de uma Opção de Taxa pertinente, a primeira Opção de Taxa pertinente no Suplemento de Fallbacks de IBORs) para a IBOR Pertinente “conforme definida” no Suplemento de Fallbacks de IBORs” (e, se esse Documento Abrangido pelo Protocolo for um Contrato Principal

Abrangido pelo Protocolo, qualquer referência à IBOR Pertinente (conforme definida nesse Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo) em uma Confirmação que complementar, fizer parte e estiver sujeita a esse Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, será uma referência à Opção de Taxa pertinente no Suplemento de Fallbacks de IBORs (ou, se houver mais de uma Opção de Taxa pertinente, a primeira Opção de Taxa pertinente no Suplemento de Fallbacks de IBORs) para a IBOR Pertinente “conforme definida no Suplemento de Fallbacks de IBORs”), sendo certo que:

(a) se a IBOR Pertinente for:

(i) “EUR-EURIBOR-Telerate”, será considerada uma referência a “EUR-EURIBOR- Reuters”;

(ii) “AUD-BBR-ISDC”, será considerada uma referência a “AUD-BBR-AUBBSW”;

(iii) “XEU-LIBOR-BBA”, será considerada uma referência a “EUR-LIBOR-BBA”;
e

(iv) “SGD-SOR-Telerate”, será considerada uma referência a “SGD-SOR-VWAP”;

em cada caso, conforme definido no Suplemento de Fallbacks de IBORs; e

(b) se a IBOR Pertinente for “THB-THBFIX-Reuters” e o Livro de Definições da ISDA Abrangido for as Definições da ISDA de 2000, o Suplemento de Fallbacks de IBORs será considerado alterado de acordo com o subparágrafo 2(e) deste Anexo.

6. Alterações a determinados Documentos Abrangidos pelo Protocolo que fazem referência a uma IBOR Pertinente

Se um Documento Abrangido pelo Protocolo for do tipo descrito no subparágrafo (c), respectivamente, da definição de Confirmação Abrangida pelo Protocolo, Documento de Garantia Abrangido pelo Protocolo ou Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo e, em cada caso, incluir uma referência a uma IBOR Pertinente, de acordo com a qual a IBOR Pertinente é necessária para qualquer determinação, e:

(a) (i) a IBOR Pertinente que for necessária para essa determinação não for a taxa do mercado de swap em Dólar de Cingapura nem a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês; (ii) a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação não tiver sido publicada pela fonte especificada ou normalmente utilizada para determinar o nível

da IBOR Pertinente no dia em que tal IBOR Pertinente é necessária; e (iii) uma Data Efetiva de Término de Índice com relação à IBOR Pertinente não tiver ocorrido, então a referência à IBOR Pertinente será considerada como uma referência à taxa fornecida pelo administrador da IBOR Pertinente e publicada por um distribuidor autorizado da IBOR Pertinente ou pelo administrador da própria IBOR Pertinente com relação ao dia em que tal IBOR Pertinente for necessária. Se nem um distribuidor autorizado nem o administrador publicaram ou forneceram a IBOR Pertinente com relação a esse dia e não tiver ocorrido uma Data Efetiva de Término de Índice com relação à IBOR Pertinente, então, a menos que de outra forma acordado pelas partes, a referência à IBOR Pertinente será considerada uma referência a:

(A) uma taxa formalmente recomendada para uso pelo administrador da IBOR Pertinente; ou

(B) uma taxa formalmente recomendada para uso por:

(I) se a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação for a LIBOR Franco Suíço, a autoridade competente responsável por supervisionar essa taxa ou o administrador dessa taxa;

(II) se a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação for a LIBOR Libra Esterlina Inglesa, LIBOR Euro ou a taxa interbancária em Euro, o supervisor responsável por supervisionar a IBOR Pertinente ou o administrador da IBOR Pertinente;

(III) se a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação for a LIBOR Iene Japonês, a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Iene Japonês ou a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Euroyen, um comitê oficialmente endossado ou convocado pelo Banco do Japão com a finalidade de recomendar uma taxa alternativa para essa IBOR Pertinente (que pode ser produzida pelo Banco do Japão ou outro administrador) ou qualquer outro supervisor que seja responsável por supervisionar a IBOR Pertinente ou o administrador da IBOR Pertinente;

(IV) se a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação for a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América, o Federal Reserve Board, o Federal Reserve Bank de Nova York ou qualquer outro supervisor que seja responsável por supervisionar a IBOR Pertinente ou o administrador da IBOR Pertinente; e

(V) se a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação for a taxa de juros BBSW, a Comissão Australiana de Valores Mobiliários e Investimentos (*Australian Securities and Investments Commission*) (ou qualquer sucessor da Comissão Australiana de Valores Mobiliários e Investimentos em seu papel de supervisor da taxa de juros BBSW),

em cada caso, durante o período de não publicação da IBOR Pertinente e enquanto não tiver ocorrido uma Data Efetiva de Término de Índice. Se uma taxa descrita no subparágrafo (A) acima estiver disponível, referida taxa será aplicável. Se tal taxa não estiver disponível, mas, com relação à IBOR Pertinente, uma taxa descrita no subparágrafo (B) acima, se aplicável, estiver disponível, essa taxa será aplicada. Se a taxa descrita no subparágrafo (A) acima nem uma taxa descrita no subparágrafo (B) acima estiverem disponíveis, se aplicável, estiver disponível, então, o Agente de Cálculo determinará uma alternativa comercialmente razoável para a IBOR Pertinente, levando em conta qualquer taxa implementada pelas contrapartes centrais e/ou bolsas de futuros, em cada caso com volumes de negociação em derivativos ou futuros referenciados na IBOR Pertinente que o Agente de Cálculo considerar suficiente para que essa taxa seja uma taxa alternativa representativa.

Se a IBOR Pertinente for a taxa interbancária do mercado de Hong Kong e o Documento Abrangido pelo Protocolo prever que os acordos decorrentes de tufão e tempestade da Hong Kong Association of Banks (ou qualquer sucessor) (conforme publicados no website da Hong Kong Association of Banks ou no website de qualquer sucessor) se aplicam, então esses acordos decorrentes de tufão e tempestade continuarão sendo aplicados e deverão prevalecer às disposições deste parágrafo 6(a);

(b) (i) a IBOR Pertinente que for necessária para essa determinação for a taxa de swap em Dólar de Cingapura; (ii) a taxa de swap em Dólar de Cingapura não tiver sido publicada pela fonte especificada ou normalmente utilizada para determinar o nível da taxa de swap em Dólar de Cingapura no dia em que tal taxa for necessária; e (iii) uma Data Efetiva de Término de Índice com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América não tiver ocorrido, então a referência à taxa de swap em Dólar de Cingapura será considerada uma referência à taxa substituta anunciada pela ABS Benchmarks Administration Co Pte. Ltd. (ou seu sucessor como administrador ou patrocinador dessa taxa) com relação à taxa de swap em Dólar de Cingapura.

Se ABS Benchmarks Administration Co Pte. Ltd. (ou seu sucessor como administrador ou patrocinador dessa taxa) não tiver anunciado uma taxa substituta até às 21h00, horário de Cingapura, na Data de Definição Original Pertinente, e uma Data Efetiva de Término de Índice com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América não tiver

ocorrido, então, a menos que acordado de outra forma pelas partes, a referência à taxa de swap de Dólar de Cingapura será considerada uma referência a:

(A) uma taxa formalmente recomendada para uso pelo administrador da taxa de swap em Dólar de Cingapura; ou

(B) uma taxa formalmente recomendada para uso pela Autoridade Monetária de Cingapura (*Monetary Authority of Singapore*) (ou qualquer outro supervisor que seja responsável por supervisionar a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou o administrador da taxa de swap em Dólar de Cingapura) ou um comitê oficialmente endossado ou convocado pela Autoridade Monetária de Cingapura (ou qualquer outro supervisor que seja responsável por supervisionar a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou o administrador da taxa de swap em Dólar de Cingapura),

em cada caso, durante o período de não publicação da taxa de swap de Dólar de Cingapura e enquanto não tiver ocorrido uma Data Efetiva de Término de Índice com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América. Se uma taxa descrita no subparágrafo (A) acima estiver disponível, referida taxa será aplicável. Se tal taxa não estiver disponível, mas uma taxa descrita no subparágrafo (B) acima estiver disponível, essa taxa será aplicável. Se nenhuma taxa descrita no subparágrafo (A) acima nem uma taxa descrita no subparágrafo (B) acima estiverem disponíveis, então, o Agente de Cálculo determinará uma alternativa comercialmente razoável para a taxa de swap em Dólar de Cingapura, levando em conta qualquer taxa implementada pelas contrapartes centrais e/ou bolsas de futuros, em cada caso com volumes de negociação em derivativos ou futuros referenciadas taxa de swap em Dólar de Cingapura que o Agente de Cálculo considerar suficiente para que essa taxa seja uma taxa alternativa representativa;

(c) (i) a IBOR Pertinente que for necessária para essa determinação for a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês; (ii) a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês não tiver sido publicada pela fonte que é especificada ou normalmente utilizada para determinar o nível da taxa de fixação de juros em Baht Tailandês no dia em que tal taxa for necessária; e (iii) uma Data Efetiva de Término de Índice com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América não tiver ocorrido, então a referência à taxa de fixação de juros em Baht Tailandês será considerada uma referência a “THB-THBFX-Reference Banks” (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006), mas com a substituição das referências a (A) “Data de Repactuação” por “o dia em que a taxa for necessária”; (B) “Vencimento Designado” por “o período de tempo com relação ao qual a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês deve ser determinada”; (C) “Período de Cálculo” por “período”; e (D) “Valor Representativo” por “um valor representativo para

uma única operação no mercado pertinente no momento pertinente”. Se a taxa não puder ser determinada de acordo com “THB-THBFIX-Reference Banks” (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) e uma Data Efetiva de Término de Índice com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América não tiver ocorrido, a taxa será determinada pelo Agente de Cálculo levando em consideração todas as informações disponíveis que, de boa-fé, julgar relevantes;

(d) sujeito aos parágrafos 6(e), (f) e (g) abaixo, tiver ocorrido um Evento de Término de Índice com relação à IBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap de Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América), então a referência à IBOR Pertinente será considerada uma referência à Taxa de Fallback Aplicável (i) a partir da (e incluindo a) Data Efetiva de Término de Índice ou, (ii) se a IBOR Pertinente for observada em um dia que for um período de tempo antes da data para a qual a IBOR Pertinente for definida, a partir desse período de tempo após a Data Efetiva de Término de Índice, sendo certo que:

(i) se a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa de Fallback (SONIA), a Taxa de Fallback (SARON), a Taxa de Fallback (SOFR), a Taxa de Fallback (EuroSTR), a Taxa de Fallback (TONA), a Taxa de Fallback (AONIA), a Taxa de Fallback (CORRA), a Taxa de Fallback (HONIA), a Taxa de Fallback (SOR) ou a Taxa de Fallback (THBFIX), então a taxa para a Data de Definição Original Pertinente será a Taxa de Fallback Aplicável para o “Dia de Registro da Taxa IBOR Original” (ou, se a Taxa de Fallback (SOR) ou a Taxa de Fallback (THBFIX) for a Taxa de Fallback Aplicável, para o “Dia de Registro da Taxa SOR Original” ou o “Dia de Registro da Taxa THBFIX Original”, conforme aplicável) corresponde à Data de Definição Original Pertinente, conforme mais recentemente fornecido ou publicado no Prazo Limite Aplicável. Caso nem o provedor da Taxa de Fallback Aplicável (ou um provedor sucessor que, se a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa de Fallback (SONIA), a Taxa de Fallback (SARON), a Taxa de Fallback (SOFR), a Taxa de Fallback (EuroSTR), a Taxa de Fallback (TONA), a Taxa de Fallback (AONIA), a Taxa de Fallback (CORRA) ou a Taxa de Fallback (HONIA), for aprovado e/ou indicado pela ISDA de tempos em tempos), nem quaisquer distribuidores autorizados publicarem, a Taxa de Fallback Aplicável para aquele “Dia de Registro da Taxa IBOR Original” (ou aquele “Dia de Registro da Taxa SOR Original” ou o “Dia de Registro da Taxa THBFIX Original”, conforme aplicável) no ou antes do Prazo Limite Aplicável e não tiver ocorrido uma Data Efetiva de Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback Aplicável, então a taxa para a Data de Definição Original Pertinente será a Taxa de Fallback Aplicável conforme mais recentemente fornecida ou publicada no Prazo Limite Aplicável para o mais recente “Dia de Registro de Taxas IBOR Original” (ou “Dia

de Registro da Taxa SOR Original” ou “Dia de Registro da Taxa THBFIX Original”, conforme aplicável), ainda que esse dia não corresponda à Data de Definição Original Pertinente;

(ii) se (A) a Taxa de Fallback Aplicável for a SONIA, a Taxa Recomendada em Libra Esterlina, a SARON, a Taxa Recomendada pelo NWG, a Taxa da Política do SNB Modificada, a SOFR, a Taxa Recomendada pelo Fed, a OBFR, a Taxa Alvo do FOMC, a EuroSTR, a Taxa Recomendada pelo BCE, a EDFR Modificada, a TONA, a Taxa Recomendada em Iene Japonês, a AONIA, a Taxa Recomendada pelo RBA, a CORRA, a Taxa Recomendada em CAD, a Taxa Alvo do BOC, a HONIA, a Taxa Recomendada em HKD, a Taxa Recomendada pela MAS, a SORA, a Taxa Recomendada pelo BOT ou a THOR, (B) nem o administrador fornecer nem distribuidores autorizados publicarem que a Taxa de Fallback Aplicável (ou se a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa da Política do SNB Modificada ou a EDFR Modificada, o índice, a taxa de referência ou outra fonte de preço que for mencionado na definição da mesma) e (C) não tiver ocorrido uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback Aplicável, então, com relação a qualquer dia para o qual essa Taxa de Fallback Aplicável for necessária, as referências à Taxa de Fallback Aplicável serão consideradas como referências à última Taxa de Fallback Aplicável fornecida ou publicada. Se a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa da Política do SNB Modificada ou a EDFR Modificada, as referências à Taxa de Fallback Aplicável no subparágrafo 6(d)(ii)(C) acima serão consideradas como referências ao índice, taxa de referência ou outra fonte de preço referidas na definição de Taxa da Política do SNB Modificada ou EDFR Modificada, conforme aplicável; e

(iii) se a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa Bancária do Reino Unido, com relação a qualquer dia para o qual a Taxa Bancária do Reino Unido for necessária, referências à Taxa Bancária do Reino Unido serão consideradas como referências à última Taxa Bancária do Reino Unido estipulada ou publicada no fechamento dos negócios em Londres naquele dia.

Se a IBOR Pertinente for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, um Evento de Término de Índice com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América também ocorrerá se a IBOR Pertinente (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria equivalente ao “Vencimento Designado”) não tiver sido publicada, no prazo pertinente, pela fonte especificada ou normalmente utilizada para determinar o nível da IBOR Pertinente e, na Data de Definição Original Pertinente, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria equivalente ao “Vencimento Designado”) tiver sido permanentemente descontinuada ou for Não Representativa e

não houver nenhuma LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América que não tiver sido permanentemente descontinuada e que não seja Não Representativa durante um período mais longo que esse prazo pertinente, ou nenhuma LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América que não tiver sido permanentemente descontinuada e que não for Não Representativa durante um período mais curto que esse prazo pertinente. A Data Efetiva de Término de Índice relacionada será a primeira data em que não houver tal taxa mais longa ou mais curta ou, se posteriormente, a primeira data em que a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria equivalente ao "Vencimento Designado") estiver permanentemente indisponível ou for Não Representativa nesse prazo pertinente.

Para efeitos deste parágrafo 6(d), as referências a um "Dia de Registro da Taxa IBOR Original", "Dia de Registro da Taxa SOR Original" e "Dia de Registro da Taxa THBFIX Original" são para esse termo conforme utilizado na Página de Taxas de Fallback. Para os fins do parágrafo imediatamente acima, (A) as referências a uma taxa "permanentemente descontinuada" ou "permanentemente indisponível" devem ser consideradas como referências a essa taxa como sendo permanentemente descontinuada ou permanentemente indisponível após uma declaração pública ou publicação de informações que constituam um Evento de Término de Índice, de acordo com os subparágrafos (a) e (b) da definição de "Evento de Término de Índice" com relação a essa taxa no prazo pertinente; e (B) referências à "LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América" na definição de "Não Representativa" devem ser consideradas como referências à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América no prazo pertinente;

(e) se a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação não for nem a taxa de swap de Dólar de Cingapura nem a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês e:

(i) a determinação para a qual a IBOR Pertinente é necessária for normalmente feita com referência à interpolação linear entre duas taxas, cada uma das quais baseada na IBOR Pertinente, então (não obstante o parágrafo 6(d) acima) serão consideradas as disposições da Cláusula 7.9(a) das Definições da ISDA de 2006, desde que o Agente de Cálculo faça as adaptações, conforme aplicável e necessário, às disposições da Cláusula 7.9(a) das Definições da ISDA de 2006, a fim de aplicá-las ao Documento Abrangido pelo Protocolo pertinente;

(ii) a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação tiver que ser determinada com referência a uma ou mais taxas, (A) pelo menos uma das quais tiver sido permanentemente descontinuada, ou (B) se a IBOR Pertinente for uma LIBOR Pertinente, pelo menos uma delas for Não Representativa e, em qualquer caso, pelo menos dois prazos da IBOR Pertinente, pelo menos um dos quais for

menor que o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente deve ser determinada e pelo menos um dos quais for mais longo que o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente deve ser determinada, não tiverem sido permanentemente descontinuados (e, se a IBOR Pertinente for uma LIBOR Pertinente, não são Não Representativas), então serão consideradas as disposições da Cláusula 8.5 e da Cláusula 8.6 das Definições da ISDA de 2006, desde que o Agente de Cálculo faça as adaptações, conforme aplicável e necessário, às disposições das Cláusulas 8.5 e 8.6 das Definições da ISDA de 2006, a fim de aplicá-las ao Documento Abrangido pelo Protocolo pertinente;

(iii) a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação tiver que ser determinada com referência a um prazo da IBOR Pertinente que tiver sido permanentemente descontinuada (ou, se a IBOR Pertinente for uma LIBOR Pertinente, for considerada Não Representativa) e não houver prazos mais curtos ou mais longos com relação à IBOR Pertinente que não tiverem sido permanentemente descontinuados (ou, se a IBOR Pertinente for uma LIBOR Pertinente, que não for Não Representativa), então um Evento de Término de Índice será considerado como tendo ocorrido com relação à IBOR Pertinente, e a Data Efetiva de Término de Índice será a primeira data em que não houver tal prazo mais curto ou mais longo ou, se posteriormente, a primeira data em que a IBOR Pertinente no prazo estiver permanentemente indisponível (ou, se a IBOR Pertinente for uma LIBOR Pertinente, for considerada Não Representativa);

(iv) no caso de qualquer inconsistência entre as disposições do subparágrafo 6(e)(ii) ou do subparágrafo 6(e)(iii) acima e as disposições do subparágrafo 6(e)(i) acima, prevalecerá o disposto no subparágrafo 6(e)(i) acima; e

(v) no caso de qualquer inconsistência entre as disposições do subparágrafo 6(e)(ii) ou do subparágrafo 6(e)(iii) acima e do subparágrafo 6(d) acima (incluindo quaisquer termos utilizados no subparágrafo 6(d) acima e definidos abaixo), prevalecerá o disposto no subparágrafo 6(e)(ii) ou no subparágrafo 6(e)(iii) acima (conforme aplicável),

Para os fins deste parágrafo 6(e), (A) as referências a uma taxa “permanentemente descontinuada” devem ser consideradas referências a essa taxa como sendo permanentemente descontinuada após uma declaração pública ou publicação de informações que constituam um Evento de Término de Índice, de acordo com os subparágrafos (a) e (b) da definição de “Evento de Término de Índice” com relação a essa taxa no prazo pertinente; (B) referências à “LIBOR Pertinente” na definição de “Não Representativa” devem ser consideradas como referências ao prazo pertinente da LIBOR Pertinente; e (C) as Cláusulas 7.9(a), 8.5 e 8.6 das Definições da ISDA de 2006

deverão ser interpretadas em conformidade com as Cláusulas 7.3(r) e 7.3(s) das Definições da ISDA de 2006;

(f) se a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês e a determinação para a qual a IBOR Pertinente é necessária for normalmente feita com referência à interpolação linear entre duas taxas, cada uma das quais baseada na IBOR Pertinente, então (não obstante o parágrafo 6(d) acima) serão consideradas as disposições da Cláusula 7.10(a) das Definições da ISDA de 2006, desde que o Agente de Cálculo faça as adaptações, conforme aplicável e necessário, às disposições da Cláusula 7.10(a) das Definições da ISDA de 2006, a fim de aplicá-las ao Documento Abrangido pelo Protocolo pertinente.

Para efeitos deste parágrafo 6(f), a Cláusula 7.10(a) das Definições da ISDA de 2006 deve ser interpretada de acordo com as Cláusulas 7.3(r) e 7.3(s) das Definições da ISDA de 2006;

(g) se (i) a IBOR Pertinente que é necessária para essa determinação for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês e a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa de Fallback (SOR) ou Taxa de Fallback (THBFIX), conforme aplicável; (ii) a determinação para a qual a IBOR Pertinente é necessária não for normalmente feita com referência à interpolação linear entre duas taxas; e (iii) o período de tempo durante o qual a taxa é necessária (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria o “Período de Cálculo”) for mais curto que a IBOR Pertinente no prazo pertinente (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria o “Vencimento Designado”), então (não obstante o parágrafo 6(d) acima) as disposições da Cláusula 7.11(a) das Definições da ISDA de 2006 serão consideradas aplicáveis, desde que o Agente de Cálculo faça as adaptações, conforme aplicável e necessário, às disposições da Cláusula 7.11(a) das Definições da ISDA de 2006, a fim de aplicá-las ao Documento Abrangido pelo Protocolo pertinente; e

(h) se a definição, a metodologia, a fórmula ou outros meios de cálculo da IBOR Pertinente ou da Taxa de Fallback Aplicável (ou, se aplicável, do índice, da taxa de referência ou de outra fonte de preço referida na IBOR Pertinente ou na Taxa de Fallback Aplicável) forem modificados, cada parte reconhece que, a menos que especificado ou acordado de outra forma, as referências a essa IBOR Pertinente ou à Taxa de Fallback Aplicável (ou ao índice, à taxa de referência ou à outra fonte de preço referida na IBOR Pertinente ou na Taxa de Fallback Aplicável) serão interpretadas como referências à IBOR Pertinente ou à Taxa de Fallback Aplicável (ou ao índice, à taxa de referência ou à outra fonte de preço referida na IBOR Pertinente ou na Taxa de Fallback Aplicável), conforme modificada. No caso de qualquer inconsistência entre este

parágrafo 6(h) e os parágrafos 6(a) a 6(d) acima (incluindo quaisquer termos utilizados nesses parágrafos, definidos abaixo e incluindo os subparágrafos 6(e)(ii) e 6(e)(iii) acima, conforme se aplicarem ao parágrafo 6(d) acima), prevalecerá o disposto nos parágrafos 6(a) a 6(d) acima, incluindo os subparágrafos 6(e)(ii) e 6(e)(iii), conforme se aplicarem ao parágrafo 6(d) acima.

Se a IBOR Pertinente referida no Documento Abrangido pelo Protocolo for a LIBOR sem referência ou indicação da moeda da LIBOR pertinente (incluindo, para evitar dúvidas, a referência na Cláusula 7.3 (*Correções aos Preços Publicados*) das Definições de Commodities de 2005 da ISDA para “a taxa spot oferecida para depósitos na moeda de pagamento no mercado interbancário de Londres aproximadamente às 11h00, horário de Londres”), então a referência à LIBOR (como quer que esteja definida ou descrita) no Documento Abrangido pelo Protocolo será considerada como uma referência à LIBOR na moeda do pagamento relacionado para o qual a LIBOR é necessária, de acordo com os termos do Documento Abrangido pelo Protocolo e parágrafos 6(a), 6(d) e 6(e) acima, e as definições relacionadas abaixo deverão ser interpretadas dessa forma.

Para efeitos de qualquer Documento Abrangido pelo Protocolo que não inclui uma definição de “Agente de Cálculo”, o termo “Agente de Cálculo” deverá ser considerado como uma referência a uma parte ou partes que normalmente seriam responsáveis pelo cálculo ou determinação de quaisquer taxas ou valores a pagar, nos termos do Documento Abrangido pelo Protocolo pertinente, e pelo cumprimento de quaisquer deveres associados a tal cálculo ou determinação.

Se (i) o Documento Abrangido pelo Protocolo ao qual este parágrafo 6 se aplica for um Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo; (ii) a IBOR Pertinente for definida no Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo; e (iii) essa definição for mencionada em uma Confirmação que complementa, faz parte e está sujeita a esse Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo, então a referência no Contrato Principal Abrangido pelo Protocolo à IBOR Pertinente, conforme alterado por este parágrafo 6, também se aplicará à referência à IBOR Pertinente nessa Confirmação.

Para tanto:

“**Dias Bancários Aplicáveis**” significa, se a IBOR Pertinente for:

(a) a LIBOR Franco Suíço, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América ou a LIBOR Iene Japonês, Dias Bancários em Londres (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006);

(b) a LIBOR Euro ou a taxa interbancária em Euro, Dias de Liquidação Alvo (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006);

(c) a taxa interbancária de Tóquio em Iene Japonês ou a taxa interbancária de Tóquio em Euroyen, Dias Bancários em Tóquio (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006);

(d) a taxa de swap em Dólar de Cingapura, Dias Bancários em Cingapura e Londres (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006); e

(e) a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, Dias Bancários em Bangkok (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006).

“Prazo Limite Aplicável” significa:

(a) para a Taxa de Fallback (SONIA), 11h30, horário de Londres;

(b) para a Taxa de Fallback (SARON), 20h30, horário de Zurique;

(c) para a Taxa de Fallback (SOFR), 10h30, horário da cidade de Nova York;

(d) para a Taxa de Fallback (EuroSTR), 11h30, horário de Frankfurt;

(e) para a Taxa de Fallback (TONA), 12h30, horário de Tóquio;

(f) para a Taxa de Fallback (AONIA), 11h30, horário de Sydney;

(g) para a Taxa de Fallback (CORRA), 11h30, horário de Toronto;

(h) para a Taxa de Fallback (HONIA), 19h30, horário de Hong Kong;

(i) para a Taxa de Fallback (SOR), 11h30, horário da cidade de Nova York; e

(j) para a Taxa de Fallback (THBFIX), 10h00, horário de Bangkok,

em cada caso, no Dia de Observação do Fallback.

“Taxa de Fallback Aplicável” significa, com relação a uma IBOR Pertinente, para fins de:

(a) LIBOR Libra Esterlina Inglesa, Taxa de Fallback (SONIA) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback com relação à Taxa de Fallback (SONIA), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer em ou após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SONIA) será a Sterling Overnight Index Average (“**SONIA**”), taxa administrada pelo Banco da Inglaterra (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SONIA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SONIA)”, após fazer tais ajustes à SONIA, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da SONIA em comparação com a Taxa de Fallback (SONIA) e por referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SONIA) e à SONIA, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (SONIA), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à SONIA), será a Taxa Recomendada em Libra Esterlina, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SONIA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SONIA)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada em Libra Esterlina, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada em Libra Esterlina em comparação com a Taxa de Fallback (SONIA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se (i) não houver uma Taxa Recomendada em Libra Esterlina antes do término do primeiro Dia Bancário em Londres (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SONIA) (ou, se posteriormente, no término do primeiro Dia Útil em Londres após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à SONIA); ou (ii) houver uma Taxa Recomendada em Libra Esterlina e uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback ocorrer posteriormente em relação a ela, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (SONIA, ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à SONIA), ou na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa Recomendada em Libra Esterlina, ou após tal data (conforme aplicável), será a Taxa Bancária do Reino Unido, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SONIA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SONIA)”, após fazer tais ajustes à Taxa

Bancária do Reino Unido, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Bancária do Reino Unido em comparação com a Taxa de Fallback (SONIA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

(b) LIBOR Franco Suíço, Taxa de Fallback (SARON) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON), ou após tal data, será a Swiss Average Rate Overnight (“**SARON**”), taxa administrada pelo SIX Swiss Exchange AG (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SARON)”, após fazer tais ajustes à SARON, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da SARON em comparação com a Taxa de Fallback (SARON) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON) e à SARON, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (SARON), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à SARON), será a Taxa Recomendada pelo NWG, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SARON)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada pelo NWG, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada pelo NWG em comparação com a Taxa de Fallback (SARON) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se não houver uma Taxa Recomendada pelo NWG antes do término do primeiro Dia Bancário em Zurique (conforme definido pelas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON) (ou, se posteriormente, o término do primeiro Dia Bancário em Zurique após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à SARON), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à SARON), será a Taxa da Política do SNB Modificada, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em

relação à Taxa de Fallback (SARON), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SARON)”, depois de fazer tais ajustes na Taxa da Política do SNB Modificada, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa da Política do SNB Modificada em comparação com a Taxa de Fallback (SARON) e por referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg;

(c) LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América, Taxa de Fallback (SOFR) ou se ocorrer um Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR), ou após tal data, será a Secured Overnight Financing Rate (“**SOFR**”), taxa administrada pelo Federal Reserve Bank de Nova York (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SOFR)”, após fazer tais ajustes à SOFR, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da SOFR em comparação com a Taxa de Fallback (SOFR) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR) e à SOFR, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à SOFR), será a Taxa Recomendada pelo Fed, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SOFR)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada pelo Fed, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada pelo Fed em comparação com a Taxa de Fallback (SOFR) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se não houver nenhuma Taxa Recomendada pelo Fed antes do término do primeiro Dia Útil do Mercado de Títulos do Governo dos EUA (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR) (ou, se posteriormente, no término do primeiro Dia Útil de Valores Mobiliários do Governo dos EUA após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à SOFR) ou houver uma Taxa Recomendada pelo Fed e uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback ocorrer posteriormente em relação a ela, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data

Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (SOFR), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à SOFR), ou na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa Recomendada pelo Fed, ou após tal data (conforme aplicável), será a OBFR, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SOFR)”, após fazer tais ajustes à OBFR, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da OBFR em comparação com a Taxa de Fallback (SOFR) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se (i) não houver nenhuma Taxa Recomendada pelo Fed, ou (ii) houver uma Taxa Recomendada pelo Fed e uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback ocorrer posteriormente em relação a ela, e também ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à OBFR, então a Taxa de Fallback Aplicável para o Dia de Observação do Fallback que ocorrer Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à OBFR, ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa Recomendada pelo Fed, SOFR ou Taxa de Fallback (SOFR), conforme aplicável), será a Taxa Alvo do FOMC, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (SOFR), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (SOFR)”, após fazer tais ajustes à Taxa Alvo do FOMC, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Alvo do FOMC em comparação com a Taxa de Fallback (SOFR) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg;

(d) LIBOR Euro e a taxa interbancária em Euro, Taxa de Fallback (EuroSTR) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR), ou após tal data, será a Euro Short-Term Rate (“**EuroSTR**”), taxa administrada pelo Banco Central Europeu (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (EuroSTR)”, após fazer tais ajustes à EuroSTR, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da EuroSTR em comparação com a Taxa de Fallback (EuroSTR) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR) e à EuroSTR, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia

de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à EuroSTR), será a Taxa Recomendada pelo BCE, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (EuroSTR)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada pelo BCE, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada pelo BCE em comparação com a Taxa de Fallback (EuroSTR) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se (i) não houver nenhuma Taxa Recomendada pelo BCE antes do término do primeiro Dia de Liquidação Alvo (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR) (ou, se posteriormente, no término do primeiro Dia de Liquidação Alvo após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à EuroSTR); ou (ii) uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback com respeito à Taxa Recomendada pelo BCE ocorrer posteriormente, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (EuroSTR), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à EuroSTR), ou na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa Recomendada pelo BCE, ou após tal data (conforme aplicável), será a EDFR Modificada, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (EuroSTR)”, após fazer tais ajustes à EDFR Modificada, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da EDFR Modificada em comparação com a Taxa de Fallback (EuroSTR) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

(e) LIBOR Iene Japonês, a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Iene Japonês e a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Euroyen, a Taxa de Fallback (TONA) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (TONA), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (TONA), ou após tal data, será a Tokyo Overnight Average Rate (“**TONA**”), taxa administrada pelo Banco do Japão (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (TONA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (TONA)”, após fazer tais ajustes à TONA, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo

da TONA em comparação com a Taxa de Fallback (TONA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (TONA) e à TONA, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (TONA), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à TONA), será a Taxa Recomendada em Iene Japonês, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (TONA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (TONA)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada em Iene Japonês, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada em Iene Japonês em comparação com a Taxa de Fallback (TONA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

(a) a taxa de juros BBSW, Taxa de Fallback (AONIA) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback com relação à Taxa de Fallback (AONIA), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (AONIA), ou após tal data, será a taxa média interbancária overnight do RBA (“**AONIA**”) administrada pelo Reserve Bank of Australia (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (AONIA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (AONIA)”, após fazer tais ajustes à AONIA, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da AONIA em comparação com a Taxa de Fallback (AONIA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (AONIA) e à AONIA, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (AONIA), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à AONIA), será a Taxa Recomendada pelo RBA, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (AONIA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (AONIA)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada pelo RBA, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada pelo RBA em comparação com a Taxa de Fallback (AONIA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

(a) a taxa em Dólar Canadense, Taxa de Fallback (CORRA) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback com relação à Taxa de Fallback (CORRA), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (CORRA), ou após tal data, será a Canadian Overnight Index Average (“**CORRA**”), taxa administrada pelo Bank of Canada (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (CORRA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (CORRA)”, após fazer tais ajustes à CORRA, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da CORRA em comparação com a Taxa de Fallback (CORRA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (CORRA) e à CORRA, então, a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (CORRA), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à CORRA), será a Taxa Recomendada em CAD, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (CORRA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (CORRA)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada em CAD, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada em CAD em comparação com a Taxa de Fallback (CORRA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se (i) não houver nenhuma Taxa Recomendada em CAD antes do término do primeiro Dia Útil em Toronto (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (CORRA) (ou, se posteriormente, no término do primeiro Dia Útil em Toronto após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à CORRA); ou (ii) houver uma Taxa Recomendada em CAD e uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback ocorrer posteriormente em relação a ela, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (CORRA), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à CORRA), ou na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa Recomendada em CAD, ou após tal data (conforme aplicável), será a Taxa Alvo do BOC, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (CORRA), mencionada na definição de “Taxa

de Fallback (CORRA)”, após fazer tais ajustes à Taxa Alvo do BOC, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Alvo do BOC em comparação com a Taxa de Fallback (CORRA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg;

(h) a taxa interbancária do mercado de Hong Kong, Taxa de Fallback (HONIA) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback com relação à Taxa de Fallback (HONIA), então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (HONIA), ou após tal data, será a Hong Kong Dollar Overnight Index Average (“**HONIA**”), taxa administrada pela Treasury Markets Association (ou qualquer administrador sucessor), à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (HONIA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (HONIA)”, após fazer tais ajustes à HONIA, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da HONIA em comparação com a Taxa de Fallback (HONIA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg.

Se ocorrer uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (HONIA) e à HONIA, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (HONIA), ou após tal data (ou, se posteriormente, a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à HONIA), será a Taxa Recomendada em HKD, à qual o Agente de Cálculo aplicará o spread mais recentemente publicado, na Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (HONIA), mencionada na definição de “Taxa de Fallback (HONIA)”, após fazer tais ajustes à Taxa Recomendada em HKD, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da Taxa Recomendada em HKD em comparação com a Taxa de Fallback (HONIA) e com referência ao Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg;

(i) a taxa de swap em Dólar de Cingapura, a Taxa de Fallback (SOR) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback com relação à Taxa de Fallback (SOR), então (i) a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (SOR), ou após tal data, será a Taxa Recomendada pela MAS; ou (ii) se não houver Taxa Recomendada pela MAS antes do término do primeiro Dia Útil em Cingapura (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (SOR), ou houver uma Taxa Recomendada pela MAS e uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback

ocorrer posteriormente em relação a ela, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (SOR), ou após tal data, ou na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa Recomendada pela MAS, ou após tal data (conforme aplicável), será a SOR, à qual o Agente de Cálculo fará tais ajustes, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da SOR em comparação com a Taxa de Fallback (SOR) e com referência à Metodologia de Cálculo para a Taxa de Fallback (SOR); e

(j) a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, a Taxa de Fallback (THBFIX) ou se tiver ocorrido um Evento de Término de Índice Fallback com relação à Taxa de Fallback (THBFIX), então (i) a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (THBFIX), ou após tal data, será a Taxa Recomendada pelo BOT; ou (ii) se não houver Taxa Recomendada pelo BOT antes do término do primeiro Dia Útil em Bangkok (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (THBFIX), ou houver uma Taxa Recomendada pelo BOT e uma Data Efetiva do Término de Índices Fallback ocorrer posteriormente em relação a ela, então a Taxa de Fallback Aplicável para qualquer Dia de Observação do Fallback que ocorrer na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa de Fallback (THBFIX), ou após tal data, ou na Data Efetiva do Término de Índices Fallback com relação à Taxa Recomendada pelo BOT, ou após tal data (conforme aplicável), será a THOR, à qual o Agente de Cálculo fará tais ajustes, conforme necessário, para incluir qualquer diferença na estrutura de prazos ou no prazo da THOR em comparação com a Taxa de Fallback (THBFIX) e com referência ao Regulamento de Ajustes de Taxas de Fallback da THBFIX do Banco da Tailândia.

“Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback THBFIX do Banco da Tailândia” significa o Regulamento de Ajustes de Taxas de Fallback da THBFIX do Banco da Tailândia, conforme atualizado de tempos em tempos.

“Regulamento de Ajustes da Taxa de Fallback de IBOR da Bloomberg” significa o Regulamento de Ajustes de Taxa de Fallback de IBORs publicado pela Bloomberg Index Services Limited (ou um provedor sucessor, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), conforme eventualmente atualizado de acordo com seus termos.

“Taxa Alvo do BOC” significa a Meta do Banco do Canadá para a Taxa Overnight, definida pelo Banco do Canadá e publicada no Website do Banco do Canadá (*Bank of Canada*) (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006).

"Taxa Recomendada pelo BOT" significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como a substituição da Taxa de Fallback (THBFIX) pelo Banco da Tailândia ou por um comitê oficialmente endossado ou convocado pelo Banco da Tailândia (que pode ser produzido pelo Banco da Tailândia ou outro administrador) e conforme fornecida pelo administrador dessa taxa com relação ao dia para o qual essa taxa é necessária (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria a "Data de Repactuação") ou, se essa taxa não for fornecida pelo administrador dessa taxa (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

"Taxa Recomendada em CAD" significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como substituição da CORRA por um comitê oficialmente endossado ou convocado pelo Banco do Canadá com o propósito de recomendar uma substituição para a CORRA (taxa que pode ser produzida pelo Banco do Canadá ou outro administrador) e conforme estipulado pelo administrador dessa taxa ou, se essa taxa não for estipulada pelo administrador da mesma (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

"Metodologia de Cálculo para Taxa de Fallback (SOR)" significa a Metodologia de Cálculo para Taxa de Fallback (SOR) publicada pela ABS Benchmarks Administration Co Pte. Ltda., conforme atualizada eventualmente.

"Taxa Recomendada pelo BCE" significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como substituição da EuroSTR pelo Banco Central Europeu (ou qualquer administrador sucessor da EuroSTR) e/ou por um comitê oficialmente endossado ou convocado pelo Banco Central Europeu (ou qualquer administrador sucessor da EuroSTR) com o propósito de recomendar uma substituição para a EuroSTR (taxa que pode ser produzida pelo Banco Central Europeu ou outro administrador) e conforme estipulado pelo administrador dessa taxa ou, se essa taxa não for estipulada pelo administrador da mesma (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

"Spread da EDFR" significa:

(a) se nenhuma Taxa Recomendada pelo BCE for recomendada antes do término do primeiro Dia de Liquidação Alvo (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR) (ou, se posteriormente, antes do término do primeiro Dia de Liquidação ALVO após a Data Efetiva do Término de Índices Fallback em relação ao EuroSTR), a média aritmética da diferença diária entre a EuroSTR e a Eurosystem Deposit Facility Rate durante um período de observação de 30 Dias de Liquidação Alvo, contados a

partir de 30 Dias de Liquidação Alvo anteriores ao dia em que ocorrer o Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR) (ou, se posteriormente, 30 Dias de Liquidação Alvo antes do dia em que ocorrer o primeiro Evento de Término de Índice Fallback em relação à EuroSTR) e terminando no Dia de Liquidação Alvo imediatamente anterior ao dia em que ocorrer o Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (EuroSTR) (ou, se posteriormente, o Dia de Liquidação ALVO imediatamente anterior ao dia em que ocorrer o primeiro Evento de Término de Índice Fallback em relação à EuroSTR); ou

(b) se ocorrer um Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa Recomendada pelo BCE, a média aritmética da diferença diária entre a Taxa Recomendada pelo BCE e a Eurosystem Deposit Facility Rate durante um período de observação de 30 Dias de Liquidação Alvo, contados a partir de 30 Dias de Liquidação Alvo anteriores ao dia em que ocorrer o Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa Recomendada pelo BCE e terminando no Dia de Liquidação Alvo imediatamente anterior ao dia em que ocorrer esse Evento de Término de Índice Fallback.

“Eurosystem Deposit Facility Rate” significa a taxa sobre o instrumento de depósito, que os bancos podem usar para fazer depósitos overnight com o Eurosystem e que é publicada no Website do BCE (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006).

“Data Efetiva do Término de Índices Fallback” significa, com relação a um Evento de Término de Índice Fallback, a primeira data em que a Taxa de Fallback Aplicável não for mais fornecida. Se a Taxa de Fallback Aplicável deixar de ser fornecida no mesmo dia em que teria sido observada, mas tiver sido fornecida no momento em que é normalmente observada (ou, se não for especificado no momento, no momento em que é normalmente publicada), então a Data Efetiva do Término de Índices Fallback será o dia seguinte em que a taxa normalmente teria sido publicada. Se a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa da Política do SNB Modificada ou a EDFR Modificada, as referências à Taxa de Fallback Aplicável nesta definição de “Data Efetiva do Término de Índices Fallback” serão consideradas como referências ao índice, à taxa de referência ou a outra fonte de preço referidos na definição de Taxa da Política do SNB Modificada ou EDFR Modificada, conforme aplicável.

“Evento de Término de Índice Fallback” significa, com relação a uma Taxa de Fallback Aplicável:

(a) uma declaração pública ou publicação de informações pelo ou em nome do administrador ou provedor da Taxa de Fallback Aplicável anunciando que ele deixou ou deixará de fornecer a Taxa de Fallback Aplicável permanente ou indefinidamente, desde

que, no momento da declaração ou publicação, não haja administrador ou provedor sucessor que continue fornecendo a Taxa de Fallback Aplicável; ou

(b) se a Taxa de Fallback Aplicável for:

(i) a Taxa de Fallback (SONIA), a Taxa de Fallback (SARON), a Taxa de Fallback (SOFR), a Taxa de Fallback (EuroSTR), a Taxa de Fallback (TONA), a Taxa de Fallback (AONIA), a Taxa de Fallback (CORRA) ou a Taxa de Fallback (HONIA), uma declaração pública ou publicação de informações pelo supervisor regulatório para o administrador da Taxa Subjacente, o banco central para a moeda da Taxa Subjacente, uma autoridade de insolvência com jurisdição sobre o administrador para a Taxa Subjacente, uma autoridade de deliberação com jurisdição sobre o administrador para a Taxa Subjacente, um tribunal ou uma entidade com autoridade de insolvência ou deliberação semelhante sobre o administrador para a Taxa Subjacente, que afirma que o administrador da Taxa Subjacente deixou ou deixará de fornecer a Taxa Subjacente permanente ou indefinidamente, desde que, no momento da declaração ou publicação, não haja administrador sucessor que continue fornecendo a Taxa Subjacente; ou

(ii) a SONIA, a Taxa Recomendada em Libra Esterlina, SARON, a Taxa Recomendada pelo NWG, a Taxa da Política do SNB Modificada, a SOFR, a Taxa Recomendada pelo Fed, a OBFR, a Taxa Alvo do FOMC, a EuroSTR, a Taxa Recomendada pelo BCE, a EDFR Modificada, a TONA, a Taxa Recomendada em Iene Japonês, a AONIA, a Taxa Recomendada pelo RBA, a CORRA, a Taxa Recomendada em CAD, a Taxa Alvo do BOC, a HONIA, a Taxa Recomendada em HKD, a Taxa de Fallback (SOR), a Taxa Recomendada pela MAS, a SORA, Taxa de Fallback (THBFIX), a Taxa Recomendada pelo BOT ou a THOR, uma declaração pública ou publicação de informações do supervisor regulatório para o administrador ou provedor da Taxa de Fallback Aplicável, o banco central para a moeda da Taxa de Fallback Aplicável, uma autoridade de insolvência com jurisdição sobre o administrador ou provedor da Taxa de Fallback Aplicável, uma autoridade de deliberação com jurisdição sobre o administrador ou provedor para a Taxa de Fallback Aplicável ou uma entidade com autoridade de insolvência ou deliberação semelhante sobre o administrador ou provedor da Taxa de Fallback Aplicável, que afirma que o administrador ou provedor da Taxa de Fallback Aplicável deixou ou deixará de fornecer a Taxa de Fallback Aplicável permanente ou indefinidamente, desde que, no momento da declaração ou publicação, não haja administrador ou provedor sucessor que continue fornecendo a Taxa de Fallback Aplicável.

Se a Taxa de Fallback Aplicável for a Taxa da Política do SNB Modificada ou a EDFR Modificada, as referências ao administrador ou provedor de tal taxa nesta definição de “Evento de Término de Índice Fallback” serão consideradas referências ao administrador ou provedor do índice, taxa de referência ou outra fonte de preço referidos na definição de Taxa da Política do SNB Modificada ou EDFR Modificada, conforme aplicável.

“**Dia de Observação do Fallback**” significa, com relação a uma Taxa de Fallback Aplicável, o dia que são dois Dias Úteis (conforme definido no Documento Abrangido pelo Protocolo pertinente ou, se esse termo não for definido nele, conforme definido nas Definições da ISDA de 2006 e, em cada caso, para fins do pagamento que é calculado com referência à Taxa de Fallback Aplicável) anteriores ao dia em que o pagamento com referência a essa taxa é devido (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria equivalente à “Data de Pagamento”), salvo acordo em contrário.

“**Taxa de Fallback (AONIA)**” significa a taxa AONIA com prazo ajustado mais o spread relativo à taxa de juros BBSW, em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa AONIA com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (AONIA) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“**Página de Taxas de Fallback (AONIA)**” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da taxa de juros BBSW, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“**Taxa de Fallback (CORRA)**” significa a taxa CORRA com prazo ajustado mais o spread relativo à taxa em Dólar Canadense, em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa CORRA com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (CORRA) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (CORRA)” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da taxa em Dólar Canadense, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“Taxa de Fallback (EuroSTR)” significa:

- (a) a EuroSTR com prazo ajustado; mais
- (b) se a IBOR Pertinente for:
 - (i) LIBOR Euro, o spread relativo à LIBOR Euro; ou
 - (ii) a taxa interbancária em Euro, o spread relativo à taxa interbancária em Euro,

em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa EuroSTR com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (EuroSTR) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (EuroSTR)” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da LIBOR Euro ou da taxa interbancária em Euro, conforme aplicável, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“Taxa de Fallback (HONIA)” significa a taxa HONIA com prazo ajustado mais o spread relativo à taxa interbancária de Hong Kong, em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou

nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa HONIA com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (HONIA) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (HONIA)” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da taxa interbancária de Hong Kong, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“Taxa de Fallback (SARON)” significa a taxa SARON com prazo ajustado mais o spread relativo à LIBOR Franco Suíço, em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa SARON com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (SARON) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (SARON)” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da LIBOR Franco Suíço, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“Página de Taxas de Fallback” significa, se a Taxa de Fallback Aplicável for: (a) a Taxa de Fallback (SONIA), a Página de Taxas de Fallback (SONIA); (b) a Taxa de Fallback (SARON), a Página de Taxas de Fallback (SARON); (c) a Taxa de Fallback (SOFR), a Página de Taxas de Fallback (SOFR); (d) a Taxa de Fallback (EuroSTR), a Página de Taxas de Fallback (EuroSTR); (e) a Taxa de Fallback (TONA), a Página de Taxas de Fallback (TONA); (f) a Taxa de Fallback (AONIA), a Página de Taxas de Fallback (AONIA); (g) a Taxa de Fallback (CORRA), a Página de Taxas de Fallback (CORRA); (h) a Taxa de Fallback (HONIA), a Página de Taxas de Fallback (HONIA); (i) a Taxa de

Fallback (SOR), a Página de Taxas de Fallback (SOR); (j) a Taxa de Fallback (THBFIX), a Página de Taxas de Fallback (THBFIX).

“Taxa de Fallback (SOFR)” significa a taxa SOFR com prazo ajustado mais o spread relativo à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América, em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa SOFR com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (SOFR) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (SOFR)” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“Taxa de Fallback (SONIA)” significa a taxa SONIA com prazo ajustado mais o spread relativo à LIBOR Libra Esterlina Inglesa, em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa SONIA com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (SONIA) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (SONIA)” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da LIBOR Libra Esterlina Inglesa, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“Taxa de Fallback (SOR)” significa a taxa baseada em operações reais no mercado de swap cambial de Dólar dos Estados Unidos da América/de Cingapura e uma taxa de

juros em Dólar dos Estados Unidos da América calculada com referência à “Taxa de Fallback (SOFR)”, conforme definida acima e incluindo qualquer taxa de fallback que possa ser aplicada de acordo com o subparágrafo (c) da definição de “Taxa de Fallback Aplicável” acima, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela ABS Benchmarks Administration Co Pte. Ltd. (ou um provedor sucessor), como provedora de Taxa de Fallback (SOR), na Página de Taxas de Fallback (SOR) (ou por outros meios) ou fornecida e publicada por distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (SOR)” significa o Terminal Refinitiv (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Refinitiv para o fallback da taxa de swap de Dólar de Cingapura, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através do Terminal da Refinitiv <FBKSORFIX> (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Refinitiv Pertinente em “histórico de preços”) ou qualquer outra fonte publicada designada pela ABS Benchmarks Administration Co Pte. Ltd. (ou um provedor sucessor).

“Taxa de Fallback (THBFIX)” significa a taxa baseada em operações reais no mercado de swap cambial em Dólar dos Estados Unidos da América/Baht Tailandês e uma taxa de juros em Dólar dos Estados Unidos da América calculada com referência à “Taxa de Fallback (SOFR)”, conforme definido acima e incluindo qualquer taxa de fallback que possa ser aplicada de acordo com o subparágrafo (c) da definição de “Taxa de Fallback Aplicável” acima, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pelo Banco da Tailândia (ou um provedor sucessor), como o provedor de Taxa de Fallback (THBFIX), na Página de Taxas de Fallback (THBFIX) (ou por outros meios) ou fornecida e publicada por distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (THBFIX)” significa o Terminal Refinitiv (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Refinitiv para o fallback da taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através do Terminal da Refinitiv <FBKTHBFIX> (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Refinitiv Pertinente em “histórico de preços”) ou qualquer outra fonte publicada designada pelo Banco da Tailândia (ou um provedor sucessor).

“Taxa de Fallback (TONA)” significa:

- (a) a TONA com prazo ajustado; mais
- (b) se a IBOR Pertinente for:

- (i) LIBOR Iene Japonês, o spread relativo à LIBOR Iene Japonês;
- (ii) a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Iene Japonês, o spread relativo à taxa interbancária do mercado de Tóquio; ou
- (iii) a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Euroyen, o spread relativo à taxa interbancária do mercado de Tóquio em Euroyen,

em cada caso, durante um período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, fornecida pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos), na qualidade de provedora da taxa TONA com prazo ajustado e o spread, na Página de Taxas de Fallback (TONA) (ou por outros meios) ou estipulado para, e publicado por, os distribuidores autorizados no Prazo Limite Aplicável ou antes dele.

“Página de Taxas de Fallback (TONA)” significa o Terminal da Bloomberg (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) correspondente ao ticker da Bloomberg para o fallback da LIBOR Iene Japonês, taxa interbancária do mercado de Tóquio em Iene Japonês ou a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Euroyen, conforme aplicável, para o período de tempo com relação ao qual a IBOR Pertinente será determinada, acessado através da Página <FBAK> <GO> do Terminal da Bloomberg (ou, se aplicável, acessado através do Terminal da Bloomberg <HP> <GO>) ou qualquer outra fonte publicada designada pela Bloomberg Index Services Limited (ou uma provedora sucessora, conforme aprovado e/ou nomeado pela ISDA de tempos em tempos).

“Taxa Recomendada pelo Fed” significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como substituição da SOFR pelo Federal Reserve Board ou pelo Federal Reserve Bank de Nova York, ou por um comitê oficialmente endossado ou convocado pelo Federal Reserve Board ou pelo Federal Reserve Bank de Nova York, com o propósito de recomendar um substituto para a SOFR (taxa que pode ser produzida pelo Federal Reserve Bank de Nova York ou outro administrador) e conforme estipulado pelo administrador dessa taxa ou, se essa taxa não for estipulada pelo administrador da mesma (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“Taxa Alvo do FOMC” significa a meta de taxa de juros de curto prazo definida pelo Comitê Federal de Mercado Aberto e publicada no Website do Federal Reserve (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) ou, se o Comitê Federal de Mercado Aberto não alcançar uma única taxa, o ponto médio da meta de faixa da taxa de juros de curto prazo estabelecida pelo Comitê Federal de Mercado Aberto e

publicada no Website do Federal Reserve (calculada como a média aritmética do limite superior da meta de faixa e o limite inferior da meta de faixa, arredondada, se necessário, de acordo com o método estabelecido na Cláusula 8.1(c) das Definições da ISDA de 2006).

“Taxa Recomendada em Libra Esterlina” significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como substituição para SONIA (a) pelo administrador da SONIA, se o administrador da SONIA for um banco central nacional, ou (b) se o banco central nacional administrador da SONIA não fizer uma recomendação, ou o administrador da SONIA não for um banco central nacional, por um comitê designado para este fim pela Financial Conduct Authority (ou qualquer sucessora à mesma), pelo Bank of England ou por ambas as entidade, e conforme estipulado pelo então administrador dessa taxa (ou um administrador sucessor) ou, se essa taxa não for estipulada pelo administrador da mesma (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“Taxa Recomendada em HKD” significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como substituição da HONIA pelo administrador da HONIA ou por um comitê oficialmente endossado ou convocado pelo administrador da HONIA com o propósito de recomendar uma substituição para a HONIA (taxa que pode ser produzida pelo administrador da HONIA ou outro administrador) e conforme estipulado pelo administrador dessa taxa ou, se essa taxa não for estipulada pelo administrador da mesma (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“Data Efetiva de Término de Índice” significa, com relação a uma IBOR Pertinente (ou, se a taxa de swap de Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês for a IBOR Pertinente, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América) e um ou mais Eventos de Término de Índices, a primeira data em que a IBOR Pertinente (ou, se a taxa de swap de Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês for a IBOR Pertinente, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América) (a) com relação a uma LIBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap de Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, com relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América), seja Não Representativa por referência à declaração ou publicação mais recente contemplada no subparágrafo (c) da definição de “Evento de Término de Índice” abaixo e mesmo que tal taxa continue sendo fornecida em tal data; ou (b) deixe de ser fornecida. Se a IBOR Pertinente (ou, se a taxa de oferta de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês for a IBOR Pertinente, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América) deixar de ser fornecida na Data de Definição Original Pertinente, mas tiver sido fornecida (e, em relação a uma LIBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap de Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, em relação à LIBOR

Dólar dos Estados Unidos da América), não for Não Representativa) no momento em que é normalmente observada, então a Data Efetiva de Término de Índice será o próximo dia em que a taxa normalmente teria sido publicada. Uma Data Efetiva de Término de Índice também pode ocorrer de acordo com o subparágrafo 6(d), subparágrafo 6(e)(ii) ou subparágrafo 6(e)(iii) acima.

“Evento de Término de Índice” significa, com relação a uma IBOR Pertinente:

(a) uma declaração pública ou publicação de informações pelo ou em nome do administrador da IBOR Pertinente anunciando que ele deixou ou deixará de fornecer a IBOR Pertinente permanente ou indefinidamente, desde que, no momento da declaração ou publicação, não haja administrador ou provedor sucessor que continue fornecendo a IBOR Pertinente;

(b) uma declaração pública ou publicação de informações pelo supervisor regulatório para o administrador da IBOR Pertinente, o banco central para a moeda da IBOR Pertinente, uma autoridade de insolvência com jurisdição sobre o administrador da IBOR Pertinente, uma autoridade de deliberação com jurisdição sobre o administrador da IBOR Pertinente, um tribunal ou uma entidade com autoridade de insolvência ou deliberação semelhante sobre o administrador para a IBOR Pertinente, que afirma que o administrador da IBOR Pertinente deixou ou deixará de fornecer a IBOR Pertinente permanente ou indefinidamente, desde que, no momento da declaração ou publicação, não haja administrador sucessor que continue fornecendo a IBOR Pertinente; ou

(c) se a IBOR Pertinente for a LIBOR Libra Esterlina Inglesa, a LIBOR Franco Suíço, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América, a LIBOR Euro, a LIBOR Iene Japonês, a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, uma declaração pública ou publicação de informações pelo supervisor regulamentador para o administrador da IBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap de Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, pelo supervisor regulamentador para o administrador da LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América) anunciando que (i) o supervisor regulatório determinou que a IBOR Pertinente não é mais, ou a partir de uma data futura especificada não será mais, representativa do mercado subjacente e da realidade econômica que a IBOR Pertinente se destina a medir e que sua representatividade não será restaurada e (ii) está ciente de que a declaração ou publicação dará ensejo a determinados gatilhos contratuais para fallbacks ativados por anúncios de pré-término por tal supervisor (conforme descrito) em contratos,

sendo certo que, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, as referências à “IBOR Pertinente” nos

subparágrafos (a), (b) e (c)(i) acima desta definição de “Evento de Término de Índice” serão consideradas como referências à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América.

Um Evento de Término de Índice também pode ocorrer de acordo com o subparágrafo 6(d), subparágrafo 6(e)(ii) ou subparágrafo 6(e)(iii) acima.

“**Taxa Recomendada em Iene Japonês**” significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como substituição da TONA por um comitê oficialmente endossado ou convocado pelo Banco do Japão com o propósito de recomendar uma substituição para a TONA (taxa que pode ser produzida pelo Banco do Japão ou outro administrador) e conforme estipulado pelo administrador dessa taxa ou, se essa taxa não for estipulada pelo administrador da mesma (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“**Taxa Recomendada pela MAS**” significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como a substituição da Taxa de Fallback (SOR) pela Autoridade Monetária de Cingapura (*Monetary Authority of Singapore*) ou por um comitê oficialmente endossado ou convocado pela Autoridade Monetária de Cingapura (taxa que pode ser produzida pela Autoridade Monetária de Cingapura ou outro administrador) e conforme fornecida pelo administrador dessa taxa com relação ao dia para o qual essa taxa for necessária (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria a Data de Repactuação) ou, se essa taxa não for fornecida pelo seu administrador taxa (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“**EDFR Modificada**” significa uma taxa igual à Eurosystem Deposit Facility Rate (EDFR) mais o Spread da EDFR.

“**Taxa da Política do SNB Modificada**” significa uma taxa igual à Taxa da Política do SNB mais o Spread do SNB.

“**Não Representativa**” significa, em relação a uma LIBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, em relação à LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América), que o supervisor regulamentador para o administrador da LIBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América):

(a) determinou e anunciou que a LIBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América) não é mais representativa do mercado

subjacente e da realidade econômica que se destina a medir e que a representatividade não será restaurada; e

(b) está ciente de que determinados gatilhos contratuais para fallbacks ativados por anúncios de pré-término por tal supervisor (como quer que descrito) foram ou estão acordadas em contratos,

desde que a LIBOR Pertinente (ou, se a IBOR Pertinente for a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América) seja “Não Representativa” em referência à data indicada na declaração ou publicação mais recente contemplada no subparágrafo (c) da definição de “Evento de Término de Índice” acima.

“Taxa Recomendada pelo NWG” significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como a substituição da SARON por qualquer comitê ou grupo de trabalho na Suíça, organizado da mesma forma que, ou similar a, o Grupo Nacional de Trabalho sobre Taxas de Referência em Franco Suíço que foi fundado em 2013 com o propósito de, entre outras coisas, considerar propostas de reforma das taxas de juros de referência na Suíça, e conforme estipulado pelo administrador dessa taxa ou, se essa taxa não for estipulada pelo seu administrador (ou administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“OBFR” significa a Taxa de Financiamento Bancário Overnight, conforme fornecida pelo Federal Reserve Bank de Nova York (ou um administrador sucessor) no Website do Fed de Nova York (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) ou, se essa taxa não for fornecida pelo Federal Reserve Bank de Nova York (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“Taxa Recomendada pelo RBA” significa a taxa (incluindo quaisquer spreads ou ajustes) recomendada como substituição da AONIA pelo Reserve Bank of Australia (taxa que pode ser produzida pelo Reserve Bank of Australia ou outro administrador) e conforme estipulado pelo administrador dessa taxa ou, se essa taxa não for estipulada pelo seu administrador (ou um administrador sucessor), publicada por um distribuidor autorizado.

“LIBOR Pertinente” significa LIBOR Libra Esterlina Inglesa, LIBOR Franco Suíço, LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América, LIBOR Euro e LIBOR Iene Japonês.

“Data de Definição Original Pertinente” significa, em relação a uma IBOR Pertinente e, salvo acordo em contrário, o dia em que essa IBOR Pertinente teria sido observada (que, de acordo com as Definições da ISDA de 2006, seria a “Data de Repactuação” ou,

se a IBOR Pertinente for a LIBOR Franco Suíço, a LIBOR Dólar dos Estados Unidos da América, a LIBOR Euro, a taxa interbancária em Euro, a LIBOR Iene Japonês, a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Iene Japonês, a taxa interbancária do mercado de Tóquio em Euroyen, a taxa de swap em Dólar de Cingapura ou a taxa de fixação de juros em Baht Tailandês, o dia que for dois Dias Bancários Aplicáveis antes de uma “Data de Repactuação” pertinente, conforme aplicável).

“**Taxa da Política do SNB**” significa a taxa da política do Banco Central da Suíça (Swiss National Bank).

“**Spread do SNB**” significa a mediana histórica entre a SARON e a Taxa da Política do SNB durante um período de observação de dois anos a partir de dois anos antes do dia em que ocorrer o Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON) (ou, se posteriormente, dois anos antes do dia em que ocorrer o primeiro Evento de Término de Índice Fallback em relação ao SARON) e terminando no Dia Bancário em Zurique (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) imediatamente anterior ao dia em que ocorrer o Evento de Término de Índice Fallback em relação à Taxa de Fallback (SARON) (ou, se posteriormente, o Dia Bancário em Zurique imediatamente anterior ao dia em que ocorrer o primeiro Evento de Término de Índice Fallback em relação à SARON), conforme determinado pelo Agente de Cálculo.

“**SORA**” significa a Taxa Média Overnight de Cingapura fornecida pela Autoridade Monetária de Cingapura (*Monetary Authority of Singapore*) (ou um administrador sucessor) no Website da Autoridade Monetária de Cingapura (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) (ou conforme publicada por seus distribuidores autorizados).

“**THOR**” significa a Taxa de Recompra Overnight Tailandesa fornecida pelo Banco da Tailândia como administrador da taxa de referência (ou um administrador sucessor) no Website do Banco da Tailândia (conforme definido nas Definições da ISDA de 2006) (ou conforme publicada por seus distribuidores autorizados).

“**Taxa Bancária do Reino Unido**” significa a taxa bancária oficial determinada pelo Comitê de Política Monetária do Banco da Inglaterra (*Bank of England*) e publicada pelo Banco da Inglaterra de tempos em tempos.

“**Taxa Subjacente**” significa, se a Taxa de Fallback Aplicável for: (a) a Taxa de Fallback (SONIA), a SONIA; (b) a Taxa de Fallback (SARON), a SARON; (c) a Taxa de Fallback (SOFR), a SOFR; (d) a Taxa de Fallback (EuroSTR), a EuroSTR; (e) a Taxa de Fallback (TONA), a TONA; (f) a Taxa de Fallback (AONIA), a AONIA; (g) a Taxa de Fallback (CORRA), a CORRA; e (h) a Taxa de Fallback (HONIA), a HONIA.

7. Protocolo de Juros Negativos

As partes concordam que as alterações feitas por este Protocolo não constituem uma “Provisão de Spread” (conforme definido no Protocolo de Juros Negativos do Contrato de Garantias da ISDA de 2014 publicado em 12 de maio de 2014 pela ISDA).

Copyright © 2020 por International Swaps and Derivatives Association, Inc.