

Série 128
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/01/2020

Dados de emissão da Série

Tipo Série	Sênior
Codigo Cetip	09J0012076
Codigo Isin	BRBSCSRI384
Data da Emissão	27/10/2009
Data de Vencimento	31/10/2023
Vencimento (meses)	171
Indexador	TR Mensal
Periodicidade Indexador	mensal
Agente Fiduciário	Oliveira Trust
Agência de Rating	-
Rating na Emissão	-
Quantidade	75
P.U.	R\$ 1.000.000
Valor da Emissão	R\$ 75.000.000
Juros	11,3809%
Periodicidade Amortização	mensal
Data da Primeira Amortização	01/12/2009
Forma de amortização	Fixo
% Subordinação	100%
Cedente	Vale S.A.
Tipo de Segmento	Outros
Tipo de Contrato	Compra e Venda
Tipo de oferta	Instrução CVM 476
Mercado de Distribuição	Cetip
Escriturador	Itaú Corretora de Valores S.A.
Coordenador da Oferta	0
Regime Fiduciário	Sim

Garantias Regime Fiduciário, Patrimônio Separado, Alienação Fiduciária de Cotas e Fiança

Dados em 31/1/2020

Duration (CRI)	1,93
Rating Atual	-
LTV (médio ponderado)	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	-
% Subordinação atual	100%

Movimentações/Eventos no mês

Saldo Anterior	R\$ 471.406,64
Atualização monetária	R\$ 0,00
Saldo Corrigido	R\$ 471.406,64
Amortização Unitário	R\$ 8.489,40
Saldo Final	R\$ 462.917,24
Juros Unitário	R\$ 4.110,93

Ativo x Passivo

Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 34.739.589,27
Saldo atual dos CRI Junior	R\$ 0,00
Saldo devedor total da carteira	R\$ 34.760.763,17
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 179,87
BNDU	R\$ 0,00
Excedente / (Falta)	R\$ 21.353,77

Movimentações em Conta da Série

LTV (médio ponderado)	R\$ 179,87
Entradas / Recebimentos	R\$ 945.024,64
Pagamentos CRIs	-R\$ 945.024,64
Despesas	R\$ 0,00
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 179,87

Regras do Regime de Pagamento

Aceleração de Pagamento	0,00%	< 10%
% de Reforço de Crédito	0,00%	> 90%
Atraso 180 dias	0,00%	> 7%
Atraso 360 dias	0,00%	> 7%
Pulverização	0,00%	< 100%

Disclaimer

As informações contidas neste relatório são de caráter exclusivamente informativo, não constituem uma oferta ou recomendação de investimento, não devendo ser utilizadas para a tomada de decisões. Ressalvamos que investimentos incluem fatores de liquidez, crédito, mercado, regulamentação específica, entre outros, sendo de exclusiva responsabilidade do investidor a decisão de realizar um investimento. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto. É proibida a utilização, cópia ou divulgação não autorizada das informações.