

Série 128
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
30/06/2020

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 30/6/2020

| | |
|---|------|
| Duration (CRI) | 1,61 |
| Rating Atual | - |
| LTV (médio ponderado) | - |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | - |
| % Subordinação atual | 100% |

Movimentações/Eventos no mês

| | |
|-----------------------|----------------|
| Saldo Anterior | R\$ 428.919,35 |
| Atualização monetária | R\$ 0,00 |
| Saldo Corrigido | R\$ 428.919,35 |
| Amortização Unitário | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 428.919,35 |
| Juros Unitário | R\$ 0,00 |

Ativo x Passivo

| | |
|--|--------------------|
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 32.459.199,26 |
| Saldo atual dos CRI Junior | R\$ 0,00 |
| Saldo devedor total da carteira | R\$ 31.553.899,64 |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 23.740,00 |
| BNDU | R\$ 0,00 |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 881.559,62 |

Movimentações em Conta da Série

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| LTV (médio ponderado) | R\$ 179,88 |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 968.584,76 |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 945.024,64 |
| Despesas | R\$ 0,00 |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 |
| (Aplicações) / Resgates | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 23.740,00 |

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.