

Instrumento Financeiro

Tipo: LFSC	Conta do Emissor: 79960.40-1
Código IF: LFSC21000MG	Nome Simplificado do Emissor: DAYCOVALBM
Código ISIN: BRDAYCLFNAI3	Data de Emissão: 11/02/2021
Situação: CONFIRMADO	IF Inadimplente: NÃO
Data de Alteração: 11/02/2021	Data de Registro: 11/02/2021
	Tipo de Regime: DEPOSITADO

Dados da Emissão e Registro

Quantidade Emitida: 295	Quantidade Extinta: 0
Valor Unitário de Emissão: 555.508,18000000	Quantidade Depositada: 295
Valor Financeiro de Emissão: 163.874.913,10	Quantidade Resgatada: 0
Valor Financeiro de Resgate:	
Valor de (Original): 555.508,18000000	
em: 11/02/2021	

Deferimento de Pleito BC - Troca de LFS - PE 183454; Resgate antecipado de Letras Financeiras com cláusula de subordinação (LFSN) elegíveis ao Nível II do Patrimônio de Referência (PR), LFSN18003ED/LFSN1800HGY, para fins de troca por nova LFSC elegível ao Nível I do PR, na qualidade de capital complementar, nos termos do art. 5º, 1º a 6º, da Resolução nº 4.733, de 27 de junho de 2019. Recompra a partir de 7anos após emissão, pelo valor de curva

Descrição Adicional:

Distribuição Pública:

Modelo da Distribuição:

Possui Opção de Recompra/Resgate pelo Emissor: SIM

Cláusula de Conversão/Extinção: EXTINGUIVEL

Data(s) programada(s) exercício opção recompra:

% da Curva do exercício opção recompra:

11/02/2028

A(s) data(s) e % da(s) Curva(s) relacionadas ao exercício de opção de recompra referem-se às 3 (três) próximas programações.

Limite Máximo de Conversibilidade:

Critérios para Conversão:

Recompra pelo emissor (Limite de até 3% - Resolução 4.123 Art. 7º Inciso II): SIM

Obteve Autorização do Banco Central para Elegibilidade do Ativo: SIM

Valores Atualizados

Valor de (Base de Cálculo): 555.508,18000000	em: 11/02/2021
Valor Unitário de Emissão Atualizado: 555.508,18000000	em: 08/03/2021
Preço Unitário de Juros: 934,27587745	em: 08/03/2021
Preço Unitário Atualizado: 556.442,45587745	em: 08/03/2021
Valor Financeiro Atualizado: 164.150.524,48	em: 08/03/2021

Registro de Eventos de Opções

Periodicidade de Eventos: VARIÁVEL Eventos a cada: a partir:

Forma de Pagamento

Formas de Pagamento: Pagamento periodico de juros

Rentabilidade/Indexador/Taxa Flutuante: DI

% da Taxa Flutuante: 150,00000

Taxa de Juros/Spread:

Critério de cálculo de juros:

Incorpora Juros: NÃO em: Valor Após Incorporação de Juros:

Fluxo de Pagamento de Juros

Periodicidade de Juros: CONSTANTE Juros a cada: 12 MES a partir: 11/02/2022

Dados do Evento

Data do Último Juros:

Data do Próximo Juros: 11/02/2022

Núcleo de Subordinação de Letra Financeira emitida para fins de composição do Capital Complementar do Patrimônio de Referência, com previsão de extinção permanente do direito de crédito contra a instituição emissora

1 - Considera-se ineficaz qualquer cláusula desta Letra Financeira ou de outro documento acessório em desconformidade com os requisitos estabelecidos pela legislação e pela regulamentação vigente para que o instrumento seja elegível a compor o Capital Complementar do Patrimônio de Referência (PR) e com as demais cláusulas deste Núcleo de Subordinação.

2 - O aditamento, alteração ou revogação do disposto neste Núcleo de Subordinação e das demais condições de emissão da Letra Financeira dependem de prévia autorização do Banco Central do Brasil.

3 - O pagamento desta Letra Financeira está subordinado ao pagamento dos demais passivos da instituição emissora, com exceção do pagamento dos elementos que compõem o Capital Principal, na hipótese de dissolução da instituição emissora.

4 - Esta Letra Financeira não será objeto de garantia, seguro, ou qualquer outro mecanismo que obrigue ou permita pagamento ou transferência de recursos, direta ou indiretamente, da instituição emissora, de entidade do conglomerado ou de entidade não financeira controlada, para o seu titular, de forma a comprometer a condição de subordinação de que trata o item 3.

5 - Considera-se ineficaz qualquer cláusula desta Letra Financeira ou de outro documento acessório que, direta ou indiretamente, altere o valor originalmente captado, inclusive por meio de acordos que obriguem a instituição emissora a compensar o investidor se um novo instrumento for emitido com melhores condições de remuneração, com exceção dos casos de recompra e resgate, quando previstos.

6 - A compra desta Letra Financeira não é objeto de financiamento, direto ou indireto, pela instituição emissora.

7 - O vencimento desta Letra Financeira está condicionado, exclusivamente, à ocorrência da dissolução da instituição emissora ou ao inadimplemento da obrigação de pagar a remuneração nela estipulada.

8 - A integralização dos valores relativos a esta Letra Financeira é efetuada em espécie.

9 - A recompra e o resgate antecipado desta Letra Financeira, ainda que realizados indiretamente por intermédio de entidade do conglomerado ou por entidade não financeira controlada pela instituição emissora, estão condicionados à autorização do Banco Central do Brasil, exceto nos casos previstos nos arts. 5º, § 6º, e 10, § 4º, da Resolução nº 4.733, de 27 de junho de 2019.

10 - Considera-se ineficaz qualquer cláusula desta Letra Financeira ou de outro instrumento acessório que preveja a variação das condições de remuneração após sua emissão, inclusive em função de oscilação da qualidade creditícia da instituição emissora.

11 - O pagamento da remuneração desta Letra Financeira ocorrerá apenas com recursos provenientes de lucros e reservas de lucros passíveis de distribuição no último período de apuração, ficando suspensos os pagamentos que excederem esses recursos.

12 - Na hipótese de imposição à instituição emissora, pelo Banco Central do Brasil, de restrição à distribuição de dividendos ou de outros resultados relativos às ações, quotas ou quotas-partes, elegíveis ao Capital Principal, o pagamento da remuneração desta Letra Financeira será suspenso na mesma proporção da restrição imposta.

13 - O pagamento da remuneração desta Letra Financeira será suspenso nos mesmos percentuais de que trata o art. 9º, § 4º, da Resolução nº 4.193, de 1º de março de 2013, ou outra que vier a lhe suceder, na hipótese de:

I - a instituição emissora apresentar insuficiência no cumprimento do Adicional de Capital Principal; ou
II - o pagamento acarretar o desenquadramento em relação aos requerimentos mínimos de Capital Principal, Nível I e PR.

14 - Consideram-se extintas a remuneração desta Letra Financeira não paga em virtude do disposto no item 11 e a remuneração referente ao período de suspensão levada a efeito em virtude do disposto nos itens 12 e 13.

15 - O direito de crédito representado por esta Letra Financeira será extinto no valor correspondente ao saldo computado no Nível I do PR, nas seguintes situações:

I - divulgação pela instituição emissora, na forma estabelecida pelo Banco Central do Brasil, de que seu Capital Principal está em patamar inferior a 5,125% (cinco inteiros e cento e vinte e cinco milésimos por cento) do montante dos ativos ponderados pelo risco (RWA), apurado na forma estabelecida pela Resolução nº 4.193, de 2013, ou por outra que vier a lhe suceder;
II - assinatura de compromisso de aporte de recursos para a instituição emissora, caso se configure a exceção prevista no art. 28 da Lei Complementar nº 101, de 4 de maio de 2000, que admite a utilização de recursos públicos para socorrer instituições do Sistema Financeiro Nacional mediante lei específica;
III - decretação, pelo Banco Central do Brasil, de regime de administração especial temporária ou de intervenção na instituição emissora; ou
IV - determinação do Banco Central do Brasil, segundo critérios estabelecidos em regulamento específico editado pelo Conselho Monetário Nacional.

16 - A extinção referida no item 15 não ocorrerá nas hipóteses de revisão ou de republicação de documentos que tenham sido utilizados pela instituição emissora como base para a divulgação da proporção entre o Capital Principal e o montante RWA, prevista no item 15, I.

17 - A ocorrência das situações previstas nos itens 11 a 16 não será considerada evento de inadimplemento ou outro fator que gere a antecipação do vencimento de dívidas em qualquer negócio jurídico de que participe a instituição emissora.

18 - A eficácia dos itens 11 a 15 está condicionada à vigência da autorização do Banco Central do Brasil para a utilização dos recursos captados por meio desta Letra Financeira para fins de composição do PR, de modo que cessará diante de eventual cancelamento da referida autorização, o que pode ocorrer, entre outras hipóteses decorrentes da regulamentação, em caso de descumprimento dos termos deste Núcleo de Subordinação, ainda que os atos ou cláusulas causadores da violação sejam reputados ineficazes.