

Série 186 E 187
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/12/2022

| Dados de emissão da Série | | | |
|---|--------------------------------|-------------------|--|
| Tipo Série | Sênior | Júnior | |
| Código Cetip | 10K0024718 | 10K0024721 | |
| Código Isin | BRBSCSRI4I4 | BRBSCSRI4J2 | |
| Data da Emissão | 20/11/2010 | 20/11/2010 | |
| Data de Vencimento | 20/10/2030 | 20/10/2030 | |
| Vencimento (meses) | 242 | 242 | |
| Indexador | IGPM Mensal | IGPM Mensal | |
| Periodicidade Indexador | mensal | mensal | |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | Oliveira Trust | |
| Agência de Rating | AUSTIN | - | |
| Rating na Emissão | AA- | - | |
| Quantidade | 40 | 4 | |
| P.U. | R\$ 306.682 | R\$ 340.757 | |
| Valor da Emissão | R\$ 12.267.261 | R\$ 1.363.029 | |
| Juros | 8,9916% | 28,4835% | |
| Periodicidade Amortização | mensal | mensal | |
| Data da Primeira Amortização | 20/02/2011 | 20/02/2011 | |
| Forma de amortização | Fixo | Fixo | |
| % Subordinação | 90% | 10% | |
| Cedente | Múltiplo | | |
| Tipo de Segmento | Híbrido | | |
| Tipo de Contrato | Financiamento Imobiliário | | |
| Tipo de oferta | Instrução CVM 400 | | |
| Mercado de Distribuição | Cetip | | |
| Escriturador | Itaú Corretora de Valores S.A. | | |
| Coordenador da Oferta | 0 | | |
| Regime Fiduciário | Sim | | |
| Garantias | Alienação Fiduciária | | |
| Dados em 31/12/2022 | | | |
| Duration (CRI) | 2,31 | 1,73 | |
| Rating Atual | A+ | - | |
| LTV (médio ponderado) | | 45,4% | |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Pró-Rata | Pró-Rata | |
| % Subordinação atual | 31% | 69% | |
| Movimentações/Eventos no mês | | | |
| Saldo Anterior | R\$ 93.148,81 | R\$ 2.019.037,64 | |
| Atualização monetária | -525,85 | -11.397,99 | |
| Saldo Corrigido | R\$ 92.622,96 | R\$ 2.007.639,64 | |
| Amortização Unitário | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 | |
| Saldo Final | R\$ 92.622,96 | R\$ 2.050.011,87 | |
| Juros Unitário | R\$ 666,96 | R\$ 0,00 | |
| Ativo x Passivo | | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | | -R\$ 3.720.454,58 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | | -R\$ 8.274.592,72 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | | R\$ 2.890.058,94 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | | R\$ 117.203,89 | |
| BNDU | | R\$ 395.911,90 | |
| Excedente / (Falta) | | -R\$ 8.591.872,57 | |
| Posição de Recebimento | | | |
| Cobrança do mês | | R\$ 58.656,85 | |
| A - Valores recebidos | | R\$ 26.542,78 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | | R\$ 13.928,57 | |
| C - Antecipações | | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | | R\$ 40.471,35 | |
| Créditos a Identificar | | R\$ 0,00 | |
| Total | | R\$ 40.471,35 | |
| Movimentações em Conta da Série | | | |
| Saldo Inicial | | R\$ 5.278,80 | |
| Entradas / Recebimentos | | R\$ 42.087,82 | |
| Pagamentos CRIs | | -R\$ 26.678,58 | |
| Despesas | | -R\$ 28.514,35 | |
| Transferências / Devoluções | | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | | R\$ 32.586,06 | |
| Saldo Final | | R\$ 24.759,75 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | | |
| | | Nº Contratos | |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 2.890.058,94 | 11 | |
| b - Sdo. dev. em dia | 775.004,41 | 7 | |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | - | 0 | |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 489.735,96 | 2 | |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 77.515,74 | 1 | |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | - | 0 | |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 1.547.802,83 | 1 | |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 0 | |
| i - Valores a processar | - | 0 | |
| Posição de Cobrança - BNDU Parcelado | | | |
| | | Nº Contratos | |
| a - Sdo. dev. total da carteira | - | 0 | |
| b - Sdo. dev. em dia | - | 0 | |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | - | 0 | |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | - | 0 | |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | - | 0 | |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | - | 0 | |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | - | 0 | |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 0 | |
| i - Valores a processar | - | 0 | |
| Regras do Regime de Pagamento | | | |
| Aceleração de Pagamento | | | |
| % de Reforço de Crédito | | | |
| Atraso 180 dias | 4,27% | > 7% | |
| Atraso 360 dias | 4,27% | > 7% | |
| Pulverização | | | |
| 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. | | | |