

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/08/2023

Dados de emissão da Série		
Tipo Série	Sênior	Júnior
Código Cetip	1510672691	1510672693
Código Isin	BRBSCSRI9R4	BRBSCSRI9S2
Data da Emissão	20/09/2015	20/09/2015
Data de Vencimento	20/04/2038	20/04/2038
Vencimento (meses)	275	275
Indexador	IGPM Mensal	IGPM Mensal
Periodicidade Indexador	mensal	mensal
Agente Fiduciário	Oliveira Trust	Oliveira Trust
Agência de Rating	Liberum	Liberum
Rating na Emissão	AA	-
Quantidade	88	9
P.U.	R\$ 301.364	R\$ 327.408
Valor da Emissão	R\$ 26.520.012	R\$ 2.946.668
Juros	8,0000%	25,0000%
Periodicidade Amortização	mensal	mensal
Data da Primeira Amortização	20/11/2015	20/11/2015
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 31/8/2023		
Duration (CRI)	2,43	1,76
Rating Atual	A-	-
LTV (médio ponderado)		49,2%
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial	Sequencial
% Subordinação atual	13%	87%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 41.763,93	R\$ 2.648.622,25
Atualização monetária	-805,99	-51.115,09
Saldo Corrigido	R\$ 40.957,94	R\$ 2.597.507,16
Amortização Unitário	R\$ 475,99	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 40.481,95	R\$ 2.646.260,46
Juros Unitário	R\$ 263,52	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 3.561.033,28
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 23.910.260,80
Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos		R\$ 3.272.032,64
Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado		R\$ 87.126,91
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 220.034,89
BNDU		R\$ 470.400,00
Excedente / (Falta)		-R\$ 23.421.699,64
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês		R\$ 83.497,57
A - Valores recebidos		R\$ 30.979,21
B - Atrasos (meses anteriores)		R\$ 20.364,30
C - Antecipações		R\$ 0,00
Valor total Recebido (A + B + C)		R\$ 51.343,51
Créditos a Identificar		R\$ 0,00
Total		R\$ 51.343,51
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial		R\$ 24.760,53
Entradas / Recebimentos		R\$ 51.344,12
Pagamentos CRIs		-R\$ 65.076,94
Despesas		-R\$ 10.971,93
Transferências / Devoluções		R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates		R\$ 24.000,00
Saldo Final		R\$ 1.760,53
Posição de Cobrança - Créditos Ativos		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	3.272.032,64	17
b - Sdo. dev. em dia	598.128,36	7
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	242.686,16	3
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias.	55.727,14	1
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.	2.375.490,98	6
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	87.126,91	1
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.	87.126,91	1
h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
i - Valores a processar	-	0
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	7%	< 10%
% de Reforço de Crédito	218,68%	> 90%
Atraso 180 dias	4,31%	> 7%
Atraso 360 dias	4,31%	> 7%
Pulverização	38%	< 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.