

Série 240 E 241
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
29/02/2024

| Dados de emissão da Série | | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|-------------------|
| Tipo Série | Sênior | Júnior |
| Código Cetip | 11F0034534 | 11F0034536 |
| Código Isin | BRBSCSRI5Z5 | BRBSCSRI608 |
| Data da Emissão | 13/06/2011 | 13/06/2011 |
| Data de Vencimento | 13/05/2031 | 13/05/2031 |
| Vencimento (meses) | 242 | 242 |
| Indexador | IGPM Mensal | IGPM Mensal |
| Periodicidade Indexador | mensal | mensal |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | Oliveira Trust |
| Agência de Rating | - | - |
| Rating na Emissão | - | - |
| Quantidade | 42 | 4 |
| P.U. | R\$ 305.580 | R\$ 356.509,64 |
| Valor da Emissão | R\$ 12.834.347 | R\$ 1.426.038,56 |
| Juros | 8,7000% | 40,9441% |
| Periodicidade Amortização | mensal | mensal |
| Data da Primeira Amortização | 13/08/2011 | 13/08/2011 |
| 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 29/2/2024 | | |
| Duration (CRI) | 2,80 | 1,73 |
| Rating Atual | - | - |
| LTV (médio ponderado) | - | 51,5% |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Sequencial | Sequencial |
| % Subordinação atual | 1% | 99% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 19.973,05 | R\$ 17.849.436,20 |
| Atualização monetária | 13,98 | 12.494,61 |
| Saldo Corrigido | R\$ 19.987,03 | R\$ 17.861.930,80 |
| Amortização Unitário | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 19.987,03 | R\$ 18.380.146,88 |
| Juros Unitário | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 840.353,66 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 74.483.591,13 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 3.140.291,42 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 56.845,55 | |
| BNDU | R\$ 165.190,95 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 71.961.616,87 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 44.116,62 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 21.084,24 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 30.794,13 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 51.878,37 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 51.878,37 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 6.955,85 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 53.889,93 | |
| Pagamentos CRIs | R\$ 0,00 | |
| Despesas | -R\$ 4.000,23 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 54.000,00 | |
| Saldo Final | R\$ 2.845,55 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 3.140.291,42 | 13 |
| b - Sdo. dev. em dia | 333.268,79 | 5 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 77.919,19 | 1 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 393.160,95 | 1 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | - | 0 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 58.356,47 | 1 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 2.277.586,02 | 5 |
| 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 | 10% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 77,76% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 6,58% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 6,58% | > 7% |
| Pulverização | 99% | < 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. | | |