

| Série 366-367 | | |
|---|--------------------------------|----------------|
| Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities | | |
| 31/12/2019 | | |
| 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 31/12/2019 | | |
| Duration (CRI) | 2,45 | 1,82 |
| Rating Atual | A- | - |
| LTV (médio ponderado) | 34,2% | |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Sequencial | Sequencial |
| % Subordinação atual | 56% | 44% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 111.168,18 | R\$ 806.972,05 |
| Atualização monetária | 750,4692097 | 5447,671209 |
| Saldo Corrigido | R\$ 111.918,65 | R\$ 812.419,72 |
| Amortização Unitário | R\$ 1.929,81 | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 109.988,83 | R\$ 827.668,24 |
| Juros Unitário | R\$ 720,09 | R\$ 0,00 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 9.711.735,07 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 7.506.571,81 | |
| Saldo devedor total da carteira | R\$ 8.827.909,54 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 1.520.164,29 | |
| BNDU | R\$ 1.654.012,78 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 5.216.220,27 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 301.144,02 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 246.107,25 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 138.589,59 | |
| C - Antecipações | R\$ 17.802,58 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 402.499,42 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 212,57 | |
| Total | R\$ 402.711,99 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 39.764,68 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 610.216,72 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 233.191,20 | |
| Despesas | -R\$ 19.749,68 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 198.000,00 | |
| Saldo Final | R\$ 199.040,52 | |
| Posição de Cobrança | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 8.827.909,54 | 60 |
| b - Sdo. dev. em dia | 5.897.493,92 | 35 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 992.589,50 | 11 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias. | 1.302.226,41 | 8 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 343.582,59 | 4 |
| f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 292.017,12 | 2 |
| g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | 9.096,77 | 2 |
| h - Valores a processar | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 31% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 86,46% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 0,78% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 0,78% | > 7% |
| Pulverização | 100% | < 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. | | |