

Série 257 E 258
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/10/2020

Dados de emissão da Série		
Tipo Série	Sênior	Júnior
Código Cetip	1110016821	1110017007
Código Isin	BRBSCSRI6M1	BRBSCSRI6N9
Data da Emissão	20/09/2011	20/09/2011
Data de Vencimento	20/08/2041	20/08/2041
Vencimento (meses)	364	364
Indexador	IGPM Mensal	IGPM Mensal
Periodicidade Indexador	mensal	mensal
Agente Fiduciário	Oliveira Trust	Oliveira Trust
Agência de Rating	FITCH	-
Rating na Emissão	BBB	-
Quantidade	42	4
P.U.	R\$ 302.695	R\$ 353.144
Valor da Emissão	R\$ 12.713.194	R\$ 1.412.577
Juros	8,0000%	46,3348%
Periodicidade Amortização	mensal	mensal
Data da Primeira Amortização	20/11/2011	20/11/2011
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 31/10/2020		
Duration (CRI)	6,06	2,20
Rating Atual	BBB	-
LTV (médio ponderado)	53,1%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	1%	99%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 10.466,92	R\$ 15.764.446,44
Atualização monetária	454,3474888	684302,2823
Saldo Corrigido	R\$ 10.921,27	R\$ 16.448.748,72
Amortização Unitario	R\$ 685,97	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 10.235,29	R\$ 16.978.989,29
Juros Unitário	R\$ 70,27	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 435.915,52	
Saldo atual dos CRI Junior	-R\$ 69.490.510,05	
Saldo devedor total da carteira	R\$ 5.062.648,34	
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 120.212,95	
BNDU	-R\$ 13.102,57	
Excedente / (Falta)	-R\$ 64.756.666,85	
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 82.293,80	
A - Valores recebidos	R\$ 25.910,02	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 50.409,85	
C - Antecipações	R\$ 0,00	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 76.319,87	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 76.319,87	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 9.746,70	
Entradas / Recebimentos	R\$ 103.251,90	
Pagamentos CRIs	-R\$ 31.761,98	
Despesas	-R\$ 47.410,47	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	-R\$ 30.000,00	
Saldo Final	R\$ 3.826,15	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	5.062.648,34	27
b - Sdo. dev. em dia	1.177.987,88	8
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	962.952,58	7
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	283.701,67	2
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	55.575,29	2
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	2.582.430,92	8
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	18%	< 10%
% de Reforço de Crédito	17,86%	> 90%
Atraso 180 dias	9,46%	> 7%
Atraso 360 dias	8,06%	> 7%
Pulverização	397%	< 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.