

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/08/2021

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 31/8/2021		
Duration (CRI)	2,22	1,65
Rating Atual	BBB-(fe)	-
LTV (médio ponderado)	36,2%	
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial	Sequencial
% Subordinação atual	26%	74%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 65.480,23	R\$ 1.602.545,09
Atualização monetária	394,61	9.657,63
Saldo Corrigido	R\$ 65.874,84	R\$ 1.612.202,72
Amortização Unitário	R\$ 5.505,06	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 60.369,79	R\$ 1.642.462,58
Juros Unitário	R\$ 423,84	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 5.339.784,09	
Saldo atual dos CRI Junior	-R\$ 14.922.330,61	
Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos	R\$ 4.735.959,77	
Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado	R\$ 74.719,13	
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 668.245,18	
BNDU	R\$ 1.062.928,09	
Excedente / (Falta)	-R\$ 13.720.262,53	
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 125.323,47	
A - Valores recebidos	R\$ 66.926,19	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 56.891,83	
C - Antecipações	R\$ 179.116,53	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 302.934,55	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 302.934,55	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 3.118,72	
Entradas / Recebimentos	R\$ 305.163,20	
Pagamentos CRIs	-R\$ 521.742,98	
Despesas	-R\$ 13.888,64	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	R\$ 229.537,69	
Saldo Final	R\$ 2.187,99	
Posição de Cobrança - Créditos Ativos		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	4.778.774,32	29
b - Sdo. dev. em dia	1.439.745,44	13
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	407.886,45	4
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias.	795.798,10	4
e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias.	541.901,69	1
f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	812.065,33	3
g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	738.562,76	4
h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	42.814,55	1
i - Valores a processar	-	
Posição de Cobrança - BNDU Parcelado		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	74.719,13	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.	74.719,13	1
h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	-	0
i - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	12%	< 10%
% de Reforço de Crédito	92,52%	> 90%
Atraso 180 dias	1,35%	> 7%
Atraso 360 dias	0,99%	> 7%
Pulverização	88%	< 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. Ressaltamos 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.