

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/08/2019

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	
Esriturador	Itaú Corretora de Valores S.A.	
Coordenador da Oferta	0	
Regime Fiduciário	Sim	
Garantias	Alienação Fiduciária	
Dados em 31/8/2019		
Duration (CRI)	2,48	1,84
Rating Atual	A-	-
LTV (médio ponderado)	34,8%	
Regime (Pró-rata, sequencial ou sequencial definitivo)	Pró-Rata	Pró-Rata
% Subordinação atual	59%	41%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 130.414,02	R\$ 771.941,12
Atualização monetária	1037,124339	6138,902113
Saldo Corrigido	R\$ 131.451,15	R\$ 778.080,03
Amortização Unitário	R\$ 12.182,03	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 119.269,12	R\$ 792.684,02
Juros Unitário	R\$ 845,76	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 10.534.854,95	
Saldo atual dos CRI Junior	-R\$ 7.191.802,68	
Saldo devedor total da carteira	R\$ 9.494.867,35	
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 1.027.448,27	
BNDU	R\$ 2.681.674,06	
Excedente / (Falta)	-R\$ 4.522.667,95	
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 254.474,59	
A - Valores recebidos	R\$ 195.087,75	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 217.825,51	
C - Antecipações	R\$ 239.019,02	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 651.932,28	
Créditos a Identificar	R\$ 212,57	
Total	R\$ 652.144,85	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 13.871,03	
Entradas / Recebimentos	R\$ 672.612,08	
Pagamentos CRIs	-R\$ 1.146.445,25	
Despesas	-R\$ 22.923,91	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	R\$ 492.826,30	
Saldo Final	R\$ 9.940,25	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	9.494.867,35	62
b - Sdo. dev. em dia	5.965.199,93	36
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	2.261.713,08	16
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	873.508,20	7
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	394.446,14	3
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	1
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	35%	< 10%
% de Reforço de Crédito	82,36%	> 90%
Atraso 180 dias	1,06%	> 7%
Atraso 360 dias	0,13%	> 7%
Pulverização	106%	< 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.