

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/01/2021

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 31/1/2021		
Duration (CRI)	2,26	1,68
Rating Atual	A-	-
LTV (médio ponderado)	35,4%	
Regime (Pró-rata, sequencial ou sequencial definitivo)	Pró-Rata	Pró-Rata
% Subordinação atual	37%	63%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 77.033,45	R\$ 1.179.606,20
Atualização monetária	2.524,69	38.660,34
Saldo Corrigido	R\$ 79.558,14	R\$ 1.218.266,54
Amortização Unitário	R\$ 3.929,08	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 75.629,06	R\$ 1.241.132,51
Juros Unitário	R\$ 511,88	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 6.693.883,52
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 11.283.523,02
Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos		R\$ 5.546.408,06
Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado		R\$ 66.632,63
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 1.028.083,63
BNDU		R\$ 1.237.735,72
Excedente / (Falta)		-R\$ 10.098.546,50
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 174.106,02	
A - Valores recebidos	-R\$ 104.684,77	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 253.263,00	
C - Antecipações	R\$ 247.178,91	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 395.757,14	
Créditos a Identificar	R\$ 212,57	
Total	R\$ 395.969,71	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 9.733,27	
Entradas / Recebimentos	R\$ 157.356,59	
Pagamentos CRIs	-R\$ 390.803,89	
Despesas	-R\$ 15.210,40	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	R\$ 243.037,83	
Saldo Final	R\$ 4.113,40	
Posição de Cobrança - Créditos Ativos		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	5.555.504,83	42
b - Sdo. dev. em dia	3.310.444,09	26
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	656.098,19	5
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	1.091.324,32	6
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	488.541,46	5
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	9.096,77	2
h - Valores a processar	-	-
Posição de Cobrança - BNDU Parcelado		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	66.632,63	2
b - Sdo. dev. em dia	-	1
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	-	0
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	66.632,63	1
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	-	0
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	18%	< 10%
% de Reforço de Crédito	84,29%	> 90%
Atraso 180 dias	1,00%	> 7%
Atraso 360 dias	1,00%	> 7%
Pulverização	102%	< 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.