

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/12/2020

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 31/12/2020		
Duration (CRI)	2,26	1,68
Rating Atual	A-	-
LTV (médio ponderado)	34,7%	
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Pró-Rata	Pró-Rata
% Subordinação atual	39%	61%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 78.350,12	R\$ 1.148.002,53
Atualização monetária	2.531,82	37.096,77
Saldo Corrigido	R\$ 80.881,94	R\$ 1.185.099,30
Amortização Unitario	R\$ 3.848,49	R\$ 5.493,09
Saldo Final	R\$ 77.033,45	R\$ 1.179.606,21
Juros Unitário	R\$ 520,40	R\$ 22.243,44
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 6.875.204,24	
Saldo atual dos CRI Junior	-R\$ 10.813.852,53	
Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos	R\$ 5.809.499,06	
Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado	R\$ 65.445,41	
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 1.275.416,85	
BNDU	R\$ 1.240.436,64	
Excedente / (Falta)	-R\$ 9.298.258,81	
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 173.574,46	
A - Valores recebidos	R\$ 174.902,40	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 33.408,23	
C - Antecipações	R\$ 350.313,89	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 558.624,52	
Créditos a Identificar	R\$ 212,57	
Total	R\$ 558.837,09	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 9.901,72	
Entradas / Recebimentos	R\$ 565.292,85	
Pagamentos CRIs	-R\$ 634.091,07	
Despesas	-R\$ 9.624,87	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	R\$ 78.254,64	
Saldo Final	R\$ 9.733,27	
Posição de Cobrança - Créditos Ativos		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	5.818.595,83	42
b - Sdo. dev. em dia	3.919.012,96	28
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	666.373,02	5
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	742.735,56	4
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	481.377,52	5
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	9.096,77	2
h - Valores a processar	-	-
Posição de Cobrança - BNDU Parcelado		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	65.445,41	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.	65.445,41	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 Saltadas	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	19%	< 10%
% de Reforço de Crédito	83,66%	> 90%
Atraso 180 dias	1,01%	> 7%
Atraso 360 dias	1,01%	> 7%
Pulverização	103%	< 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.