

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/05/2023

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 31/5/2023		
Duration (CRI)	2,39	1,73
Rating Atual	BBB-(fe)	-
LTV (médio ponderado)	46,6%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial	Sequencial
% Subordinação atual	15%	85%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 46.440,44	R\$ 2.575.123,75
Atualização monetária	23,88	1.324,37
Saldo Corrigido	R\$ 46.464,32	R\$ 2.576.448,12
Amortização Unitário	R\$ 535,59	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 45.928,74	R\$ 2.624.806,16
Juros Unitário	R\$ 298,95	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 4.036.783,55	
Saldo atual dos CRI Junior	-R\$ 23.696.561,28	
Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos	R\$ 3.458.834,50	
Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado	R\$ 273.848,53	
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 292.214,90	
BNDU	R\$ 524.634,72	
Excedente / (Falta)	-R\$ 23.183.812,18	
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 93.197,51	
A - Valores recebidos	R\$ 202.355,16	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 21.520,68	
C - Antecipações	R\$ 146.165,71	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 370.041,55	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 370.041,55	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 30.994,11	
Entradas / Recebimentos	R\$ 206.897,78	
Pagamentos CRIs	-R\$ 73.439,32	
Despesas	-R\$ 59.066,54	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	-R\$ 104.000,00	
Saldo Final	R\$ 1.386,03	
Posição de Cobrança - Créditos Ativos		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	3.458.834,50	19
b - Sdo. dev. em dia	426.473,45	9
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	640.968,56	4
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.	2.391.392,49	6
h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
i - Valores a processar	-	0
Posição de Cobrança - BNDU Parcelado		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	273.848,53	2
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.	186.288,87	1
g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	87.559,66	1
h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
i - Valores a processar	-	0
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	8%	< 10%
% de Reforço de Crédito	211,20%	> 90%
Atraso 180 dias	4,22%	> 7%
Atraso 360 dias	3,79%	> 7%
Pulverização	40%	< 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.