

Série 264
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/01/2024

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------------------------|--------------|
| Tipo Série | Júnior | |
| Código Cetip | 11J0018310 | |
| Código Isin | BRBSCCRI6X8 | |
| Data da Emissão | 20/10/2011 | |
| Data de Vencimento | 20/12/2040 | |
| Vencimento (meses) | 355 | |
| Indexador | Pré | |
| Periodicidade Indexador | mensal | |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | |
| Agência de Rating | - | |
| Rating na Emissão | - | |
| Quantidade | 12 | |
| P.U. | R\$ 311.577 | |
| Valor da Emissão | R\$ 3.738.925 | |
| Juros | 39,6059% | |
| Periodicidade Amortização | mensal | |
| Data da Primeira Amortização | 20/05/2012 | |
| Forma de amortização | Fixo | |
| % Subordinação | 100% | |
| Cedente | Brazilian Mortgages | |
| 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 31/1/2024 | | |
| Duration (CRI) | 2,06 | |
| Rating Atual | - | |
| LTV (médio ponderado) | 15,2% | |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | - | |
| % Subordinação atual | 100% | |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 8.998.270,28 | |
| Atualização monetária | R\$ 0,00 | |
| Saldo Corrigido | R\$ 8.998.270,28 | |
| Amortização Unitario | R\$ 0,00 | |
| Saldo Final | R\$ 9.251.972,82 | |
| Juros Unitário | R\$ 0,00 | |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | R\$ 0,00 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 111.023.673,78 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 1.522.098,87 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 130.375,82 | |
| BNDU | R\$ 1.401.985,80 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 107.969.213,29 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 40.830,19 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 24.872,97 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 412.037,18 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 436.910,15 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 436.910,15 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 11.169,38 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 38.304,67 | |
| Pagamentos CRIs | R\$ 0,00 | |
| Despesas | -R\$ 5.756,33 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 32.000,00 | |
| Saldo Final | R\$ 11.717,72 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 1.522.098,87 | 22 |
| b - Sdo. dev. em dia | 798.472,65 | 11 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 712.866,25 | 10 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 0,00 | 0 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 10.759,97 | 1 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 0,00 | 0 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 0,00 | 0 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | - |
| i - Valores a processar | - | - |
| Posição de Cobrança - BNDU Parcelado | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 0,00 | 0 |
| b - Sdo. dev. em dia | 0,00 | 0 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 0,00 | 0 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 0,00 | 0 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 0,00 | 0 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 0,00 | 0 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 0,00 | 0 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | - |
| i - Valores a processar | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 0% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 0,00% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 0,00% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 0,00% | > 7% |
| Pulverização | 0% | < 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. | | |