

Série 361 E 362
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/10/2023

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------------------------|------------------|
| Tipo Série | Sênior | Júnior |
| Código Cetip | 15E0186329 | 15E0186330 |
| Código Isin | BRBSCSRI901 | BRBSCSRI9P8 |
| Data da Emissão | 20/05/2015 | 20/05/2015 |
| Data de Vencimento | 20/03/2040 | 20/03/2040 |
| Vencimento (meses) | 302 | 302 |
| Indexador | IGPM Mensal | IGPM Mensal |
| Periodicidade Indexador | mensal | mensal |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | Oliveira Trust |
| Agência de Rating | - | - |
| Rating na Emissão | - | - |
| Quantidade | 89 | 9 |
| P.U. | R\$ 300.099 | R\$ 329.739 |
| Valor da Emissão | R\$ 26.708.844 | R\$ 2.967.649 |
| Juros | 7,2000% | 38,3730% |
| Periodicidade Amortização | mensal | mensal |
| Data da Primeira Amortização | 20/07/2015 | 20/07/2015 |
| 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 31/10/2023 | | |
| Duration (CRI) | 6,68 | 1,75 |
| Rating Atual | - | - |
| LTV (médio ponderado) | - | 50,3% |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Sequencial | Sequencial |
| % Subordinação atual | 13% | 87% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 55.098,87 | R\$ 3.546.118,57 |
| Atualização monetária | -77,14 | -4.964,57 |
| Saldo Corrigido | R\$ 55.021,73 | R\$ 3.541.154,00 |
| Amortização Unitário | R\$ 148,75 | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 54.872,98 | R\$ 3.638.304,92 |
| Juros Unitário | R\$ 319,71 | R\$ 0,00 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 4.893.746,06 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 33.060.732,83 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 5.534.566,15 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 1.321.353,62 | |
| BNDU | R\$ 1.590.832,88 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 29.507.726,24 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 109.191,12 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 22.232,14 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 7.923,05 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 30.155,19 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 30.155,19 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 11.894,70 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 397.718,73 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 41.693,42 | |
| Despesas | -R\$ 56.052,97 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 310.000,00 | |
| Saldo Final | R\$ 1.867,04 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 5.534.566,15 | 20 |
| b - Sdo. dev. em dia | 1.131.915,87 | 4 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 99.933,35 | 2 |
| 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. | 4.302.716,93 | 14 |
| 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 | - | 0 |
| 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. | - | 0 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | - | 0 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 0 |
| i - Valores a processar | - | 0 |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 14% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 125,34% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 7,56% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 7,17% | > 7% |
| Pulverização | 73% | < 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. | | |