

| Série 366-367 | | |
|---|--------------------------------|----------------|
| Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities | | |
| 30/09/2019 | | |
| 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 30/9/2019 | | |
| Duration (CRI) | 2,45 | 1,82 |
| Rating Atual | A- | - |
| LTV (médio ponderado) | 34,7% | |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Pró-Rata | Pró-Rata |
| % Subordinação atual | 58% | 42% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 119.269,12 | R\$ 792.684,01 |
| Atualização monetária | 472,4434659 | 3139,944204 |
| Saldo Corrigido | R\$ 119.741,56 | R\$ 795.823,96 |
| Amortização Unitário | R\$ 2.702,45 | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 117.039,12 | R\$ 810.760,99 |
| Juros Unitário | R\$ 770,42 | R\$ 0,00 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 10.298.488,33 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 7.325.860,33 | |
| Saldo devedor total da carteira | R\$ 9.302.330,06 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 930.139,64 | |
| BNDU | R\$ 2.681.674,06 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 4.710.204,90 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 232.730,69 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 166.401,40 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 99.537,95 | |
| C - Antecipações | R\$ 2.317,85 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 268.257,20 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 212,57 | |
| Total | R\$ 268.469,77 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 9.940,25 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 229.275,24 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 305.612,26 | |
| Despesas | -R\$ 24.794,60 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | R\$ 98.775,43 | |
| Saldo Final | R\$ 7.584,06 | |
| Posição de Cobrança | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 9.302.330,06 | 61 |
| b - Sdo. dev. em dia | 6.436.627,86 | 40 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 1.403.704,88 | 9 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias. | 1.146.459,88 | 9 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 33.128,37 | 1 |
| f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 282.409,07 | 2 |
| g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 1 |
| h - Valores a processar | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 35% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 81,51% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 0,77% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 0,77% | > 7% |
| Pulverização | 107% | < 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. | | |