

Série 257 E 258
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
30/06/2020

Dados de emissão da Série		
Tipo Série	Sênior	Júnior
Código Cetip	1110016821	1110017007
Código Isin	BRBSCSRI6M1	BRBSCSRI6N9
Data da Emissão	20/09/2011	20/09/2011
Data de Vencimento	20/08/2041	20/08/2041
Vencimento (meses)	364	364
Indexador	IGPM Mensal	IGPM Mensal
Periodicidade Indexador	mensal	mensal
Agente Fiduciário	Oliveira Trust	Oliveira Trust
Agência de Rating	FITCH	-
Rating na Emissão	BBB	-
Quantidade	42	4
P.U.	R\$ 302.695	R\$ 353.144
Valor da Emissão	R\$ 12.713.194	R\$ 1.412.577
Juros	8,0000%	46,3348%
Periodicidade Amortização	mensal	mensal
Data da Primeira Amortização	20/11/2011	20/11/2011
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 30/6/2020		
Duration (CRI)	6,10	2,20
Rating Atual	BBB	-
LTV (médio ponderado)	52,7%	
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	1%	99%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 13.108,00	R\$ 12.981.119,76
Atualização monetária	36.70774618	36352,42721
Saldo Corrigido	R\$ 13.144,71	R\$ 13.017.472,19
Amortização Unitário	R\$ 1.160,93	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 11.983,78	R\$ 13.437.102,40
Juros Unitário	R\$ 84,57	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 507.000,29
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 54.600.326,01
Saldo devedor total da carteira		R\$ 4.814.281,91
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 56.272,23
BNDU		-R\$ 12.350,51
Excedente / (Falta)		-R\$ 50.249.122,67
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês		R\$ 75.047,50
A - Valores recebidos		R\$ 25.868,62
B - Atrasos (meses anteriores)		R\$ 28.101,87
C - Antecipações		R\$ 0,00
Valor total Recebido (A + B + C)		R\$ 53.970,49
Créditos a Identificar		R\$ 0,00
Total		R\$ 53.970,49
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial		R\$ 9.056,35
Entradas / Recebimentos		R\$ 40.792,93
Pagamentos CRIs		-R\$ 52.310,98
Despesas		-R\$ 7.585,50
Transferências / Devoluções		R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates		R\$ 13.000,00
Saldo Final		R\$ 2.952,80
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	4.814.281,91	27
b - Sdo. dev. em dia	1.245.838,65	10
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	694.070,84	2
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	372.548,42	5
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	408.172,14	4
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	2.093.651,86	6
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	-	0
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	20%	< 10%
% de Reforço de Crédito	19,21%	> 90%
Atraso 180 dias	8,66%	> 7%
Atraso 360 dias	8,64%	> 7%
Pulverização	366%	< 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.		