

Série 269 E 270
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
30/04/2021

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------------------------|-----------------------|
| Tipo Série | Sênior | Júnior |
| Código Cetip | 11K0018241 | 11K0018243 |
| Código Isin | BRBSCSRI715 | BRBSCSRI723 |
| Data da Emissão | 20/11/2011 | 20/11/2011 |
| Data de Vencimento | 20/11/2041 | 20/11/2041 |
| Vencimento (meses) | 365 | 365 |
| Indexador | IGPM Mensal | IGPM Mensal |
| Periodicidade Indexador | mensal | mensal |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | Oliveira Trust |
| Agência de Rating | FITCH | - |
| Rating na Emissão | A- | - |
| Quantidade | 89 | 9 |
| P.U. | R\$ 303.310 | R\$ 333.267 |
| Valor da Emissão | R\$ 26.994.598 | R\$ 2.999.400 |
| Juros | 8,0000% | 51,1141% |
| Periodicidade Amortização | mensal | mensal |
| Data da Primeira Amortização | 20/01/2012 | 20/01/2012 |
| 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 30/4/2021 | | |
| Duration (CRI) | 5,39 | 1,99 |
| Rating Atual | A- | - |
| LTV (médio ponderado) | 41,2% | - |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Sequencial Definitivo | Sequencial Definitivo |
| % Subordinação atual | 5% | 95% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 68.661,49 | R\$ 11.049.524,27 |
| Atualização monetária | 1.734,29 | 279.094,86 |
| Saldo Corrigido | R\$ 70.395,78 | R\$ 11.328.619,12 |
| Amortização Unitario | R\$ 11.102,64 | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 59.293,13 | R\$ 11.725.167,57 |
| Juros Unitário | R\$ 452,93 | R\$ 0,00 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 5.339.678,87 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 107.779.097,72 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 8.745.944,97 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 272.056,34 | |
| BNDU | R\$ 2.147.944,00 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 101.952.831,28 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 149.650,71 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 67.435,41 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 34.652,96 | |
| C - Antecipações | R\$ 90.575,20 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 192.663,57 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 192.663,57 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 2.597,30 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 181.962,86 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 1.028.446,04 | |
| Despesas | -R\$ 19.873,25 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | R\$ 871.296,53 | |
| Saldo Final | R\$ 7.537,40 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 8.745.944,97 | 55 |
| b - Sdo. dev. em dia | 3.011.482,53 | 26 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 731.057,50 | 4 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 1.079.947,56 | 7 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 640.106,69 | 4 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 216.516,41 | 1 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 3.066.834,28 | 13 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 0 |
| i - Valores a processar | - | - |
| 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 | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 17% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 66,29% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 4,67% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 3,77% | > 7% |
| Pulverização | 135% | < 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. | | |