

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/10/2020

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 31/10/2020		
Duration (CRI)	2,30	1,71
Rating Atual	A-	-
LTV (médio ponderado)	34,3%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Pró-Rata	Pró-Rata
% Subordinação atual	41%	59%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 78.129,50	R\$ 1.031.762,83
Atualização monetária	2144,001012	28313,25651
Saldo Corrigido	R\$ 80.273,50	R\$ 1.060.076,09
Amortização Unitario	R\$ 2.273,18	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 78.000,32	R\$ 1.079.972,94
Juros Unitário	R\$ 516,48	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 6.987.694,14
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 9.937.737,47
Saldo devedor total da carteira		R\$ 6.465.243,78
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 1.182.324,97
BNDU		R\$ 977.294,54
Excedente / (Falta)		-R\$ 8.300.568,32
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 235.090,83	
A - Valores recebidos	R\$ 154.812,39	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 176.803,48	
C - Antecipações	R\$ 277.268,20	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 608.884,07	
Créditos a Identificar	R\$ 212,57	
Total	R\$ 609.096,64	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 3.892,04	
Entradas / Recebimentos	R\$ 621.248,04	
Pagamentos CRIs	-R\$ 245.490,56	
Despesas	-R\$ 11.989,29	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	-R\$ 364.000,00	
Saldo Final	R\$ 3.660,23	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	6.465.243,78	47
b - Sdo. dev. em dia	4.247.117,69	30
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	498.993,89	4
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	1.035.301,83	6
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	163.483,64	1
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	520.346,73	6
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	9.096,77	2
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	20%	< 10%
% de Reforço de Crédito	83,07%	> 90%
Atraso 180 dias	1,14%	> 7%
Atraso 360 dias	1,01%	> 7%
Pulverização	103%	< 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.