

| Série 255 E 256 | | |
|--|--------------------------------|------------------|
| Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities | | |
| 31/05/2024 | | |
| Dados de emissão da Série | | |
| Tipo Série | Sênior | Júnior |
| Código Cetip | 11H0022430 | 11H0022435 |
| Código Isin | BRBSCSRI6J7 | BRBSCSRI6K5 |
| Data da Emissão | 20/08/2011 | 20/08/2011 |
| Data de Vencimento | 20/02/2041 | 20/02/2041 |
| Vencimento (meses) | 359 | 359 |
| Indexador | Pré | Pré |
| Periodicidade Indexador | mensal | mensal |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | Oliveira Trust |
| Agência de Rating | FITCH | - |
| Rating na Emissão | A- | - |
| Quantidade | 152 | 16 |
| P.U. | R\$ 300.687 | R\$ 317.392,23 |
| Valor da Emissão | R\$ 45.704.480 | R\$ 5.078.275,68 |
| Juros | 12,5000% | 32,6066% |
| Periodicidade Amortização | mensal | mensal |
| Data da Primeira Amortização | 20/10/2011 | 20/10/2011 |
| 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 31/5/2024 | | |
| Duration (CRI) | 3,19 | 2,20 |
| Rating Atual | A- | - |
| LTV (médio ponderado) | | 41,1% |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Sequencial | Sequencial |
| % Subordinação atual | 4% | 96% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 15.839,71 | R\$ 3.214.309,65 |
| Atualização monetária | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Corrigido | R\$ 15.839,71 | R\$ 3.214.309,65 |
| Amortização Unitario | R\$ 205,51 | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 15.634,20 | R\$ 3.290.799,89 |
| Juros Unitário | R\$ 156,24 | R\$ 0,00 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 2.384.688,89 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 53.094.030,49 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 4.551.438,12 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 414.007,75 | |
| BNDU | R\$ 110.057,76 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 50.403.215,75 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 78.394,34 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 46.789,77 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 24.226,13 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 71.015,90 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 71.015,90 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 29.530,30 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 73.286,00 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 54.986,19 | |
| Despesas | -R\$ 15.129,56 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 29.795,82 | |
| Saldo Final | R\$ 2.904,73 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 4.551.438,12 | 62 |
| b - Sdo. dev. em dia | 2.070.500,32 | 37 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 460.234,81 | 10 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 199.677,81 | 5 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 4.838,35 | 1 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 214.585,63 | 2 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 1.601.601,20 | 7 |
| 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 | 4% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 68,66% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 1,31% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 1,25% | > 7% |
| Pulverização | 131% | < 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. Resalvamos 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. | | |