

Série 366-367
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/08/2020

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 31/8/2020		
Duration (CRI)	2,30	1,72
Rating Atual	A-	-
LTV (médio ponderado)	34,6%	
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Pró-Rata	Pró-Rata
% Subordinação atual	44%	56%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 87.945,79	R\$ 957.522,90
Atualização monetária	1369.320503	14908,6812
Saldo Corrigido	R\$ 89.315,11	R\$ 972.431,59
Amortização Unitario	R\$ 10.586,00	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 78.729,11	R\$ 990.683,41
Juros Unitário	R\$ 574,66	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 7.000.274,30
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 9.047.981,63
Saldo devedor total da carteira		R\$ 6.799.059,76
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 755.802,01
BNDU		R\$ 978.803,29
Excedente / (Falta)		-R\$ 7.514.590,87
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 237.793,34	
A - Valores recebidos	R\$ 203.550,18	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 352.170,75	
C - Antecipações	R\$ 6.539,91	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 562.260,84	
Créditos a Identificar	R\$ 212,57	
Total	R\$ 562.473,41	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 5.883,86	
Entradas / Recebimentos	R\$ 295.619,95	
Pagamentos CRIs	-R\$ 982.137,40	
Despesas	-R\$ 16.038,24	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	R\$ 714.479,39	
Saldo Final	R\$ 17.470,46	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	6.799.059,76	52
b - Sdo. dev. em dia	4.319.372,64	30
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	838.743,02	10
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	167.201,00	2
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	842.786,85	4
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	630.956,25	6
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	9.096,77	2
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	21%	< 10%
% de Reforço de Crédito	84,81%	> 90%
Atraso 180 dias	1,49%	> 7%
Atraso 360 dias	0,78%	> 7%
Pulverização	101%	< 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.		