

Série 235 E 236
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
30/09/2021

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------------------------|----------------|
| Tipo Série | Sênior | Júnior |
| Código Cetip | 11F0031931 | 11F0031919 |
| Código Isin | BRBSCSRI673 | BRBSCSRI681 |
| Data da Emissão | 13/06/2011 | 13/06/2011 |
| Data de Vencimento | 13/03/2041 | 13/03/2041 |
| Vencimento (meses) | 362 | 362 |
| Indexador | TR Mensal | TR Mensal |
| Periodicidade Indexador | mensal | mensal |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | Oliveira Trust |
| Agência de Rating | FITCH | - |
| Rating na Emissão | BBB | - |
| Quantidade | 19062 | 7 |
| P.U. | R\$ 1.000 | R\$ 302.575 |
| Valor da Emissão | R\$ 19.062.191 | R\$ 2.118.022 |
| Juros | 11,0000% | 3,0687% |
| Periodicidade Amortização | mensal | mensal |
| Data da Primeira Amortização | 13/08/2011 | 13/08/2011 |
| 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 30/9/2021 | | |
| Duration (CRI) | 5,25 | 7,61 |
| Rating Atual | BBB | - |
| LTV (médio ponderado) | 64,0% | - |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Pró-Rata | Pró-Rata |
| % Subordinação atual | 80% | 20% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 315,94 | R\$ 219.405,53 |
| Atualização monetária | 0,00 | 0,00 |
| Saldo Corrigido | R\$ 315,94 | R\$ 219.405,53 |
| Amortização Unitário | R\$ 7,98 | R\$ 2.914,64 |
| Saldo Final | R\$ 307,96 | R\$ 216.490,89 |
| Juros Unitário | R\$ 2,76 | R\$ 553,33 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 5.899.381,75 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 1.517.600,76 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 7.938.661,98 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 13.411,77 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 331.795,23 | |
| BNDU | R\$ 104.572,96 | |
| Excedente / (Falta) | R\$ 971.459,43 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 104.288,11 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 71.886,15 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 29.907,11 | |
| C - Antecipações | R\$ 9.906,36 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 111.699,62 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 111.699,62 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 2.231,99 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 109.362,45 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 228.958,53 | |
| Despesas | -R\$ 24.563,67 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | R\$ 157.515,85 | |
| Saldo Final | R\$ 15.588,09 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 7.938.661,98 | 77 |
| b - Sdo. dev. em dia | 4.949.000,98 | 55 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 905.897,07 | 10 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 233.333,54 | 2 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 114.031,45 | 1 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 433.486,15 | 4 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 1.302.912,79 | 5 |
| 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 | 13.411,77 | 1 |
| 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. | 13.411,77 | 1 |
| 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 | 83,51% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 2,63% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 1,51% | > 7% |
| Pulverização | 111% | < 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. | | |