

Série 269 E 270
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/08/2023

| 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 31/8/2023 | | |
| Duration (CRI) | 5,00 | 1,94 |
| Rating Atual | A- | - |
| LTV (médio ponderado) | 50,4% | - |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Sequencial Definitivo | Sequencial Definitivo |
| % Subordinação atual | 1% | 99% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 35.296,93 | R\$ 34.155.351,84 |
| Atualização monetária | -681,19 | -659.155,43 |
| Saldo Corrigido | R\$ 34.615,75 | R\$ 33.496.196,41 |
| Amortização Unitário | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | R\$ 34.615,75 | R\$ 34.668.701,60 |
| Juros Unitário | R\$ 0,00 | R\$ 0,00 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | -R\$ 3.079.609,49 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 315.010.994,99 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 7.598.386,42 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 175.416,82 | |
| BNDU | R\$ 3.031.415,56 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 307.285.385,68 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 101.836,58 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 21.671,34 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 108.725,87 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 130.397,21 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 130.397,21 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 2.058,45 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 50.365,38 | |
| Pagamentos CRIs | R\$ 0,00 | |
| Despesas | -R\$ 32.619,47 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 26.000,00 | |
| Saldo Final | R\$ 2.058,45 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 7.598.386,42 | 38 |
| b - Sdo. dev. em dia | 996.712,06 | 9 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 983.947,47 | 6 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 962.031,98 | 5 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | - | 0 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 80.184,13 | 1 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 4.575.510,78 | 17 |
| 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 | 16% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 43,77% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 6,51% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 6,05% | > 7% |
| Pulverização | 213% | < 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. | | |