

Série 262
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
30/06/2023

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------------------------|--------------------|
| Tipo Série | Única | |
| Código Cetip | 11J0012951 | |
| Código Isin | BRBSCSRI6T6 | |
| Data da Emissão | 20/10/2011 | |
| Data de Vencimento | 20/10/2041 | |
| Vencimento (meses) | 365 | |
| Indexador | IGPM Mensal | |
| Periodicidade Indexador | mensal | |
| Agente Fiduciário | Oliveira Trust | |
| Agência de Rating | FITCH | |
| Rating na Emissão | A- | |
| Quantidade | 11 | |
| P.U. | R\$ 321.987 | |
| Valor da Emissão | R\$ 3.541.858 | |
| Juros | 44,8125% | |
| Periodicidade Amortização | mensal | |
| Data da Primeira Amortização | 20/12/2014 | |
| Forma de amortização | Fixo | |
| % Subordinação | 100% | |
| 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 30/6/2023 | | |
| Duration (CRI) | 2,17 | |
| Rating Atual | A+ | |
| LTV (médio ponderado) | 35,1% | |
| Regime (Pró-rata, sequencial ou sequencial definitivo) | Pró-Rata | |
| % Subordinação atual | 100% | |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 53.464.441,40 | |
| Atualização monetária | -R\$ 985.905,59 | |
| Saldo Corrigido | R\$ 52.478.535,81 | |
| Amortização Unitario | R\$ 0,00 | |
| Saldo Final | R\$ 54.123.043,93 | |
| Juros Unitário | R\$ 8.678,05 | |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | R\$ 0,00 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 597.613.836,27 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 7.383.931,42 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 93.333,30 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 116.756,74 | |
| BNDU | R\$ 831.742,86 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 589.188.071,95 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 134.254,73 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 87.290,34 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 17.494,55 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 104.784,89 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 104.784,89 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 11.527,65 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 86.798,09 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 95.458,54 | |
| Despesas | -R\$ 13.194,48 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | R\$ 21.000,00 | |
| Saldo Final | R\$ 11.699,39 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 7.383.931,42 | Nº Contratos 29 |
| b - Sdo. dev. em dia | 2.552.751,57 | 14 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 262.671,94 | 4 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | - | 0 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 71.622,00 | 1 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 568.942,69 | 1 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 3.927.943,22 | 9 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 0 |
| i - Valores a processar | - | - |
| Posição de Cobrança - BNDU Parcelado | | |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 93.333,30 | Nº Contratos 1 |
| b - Sdo. dev. em dia | 93.333,30 | 1 |
| 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 | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 14% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 0,00% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 6,67% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 6,16% | > 7% |
| Pulverização | 0% | < 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. | | |