

Série 262
 Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
 30/09/2021

| 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 30/9/2021 | | |
| Duration (CRI) | 2,10 | |
| Rating Atual | A+ | |
| LTV (médio ponderado) | 38,5% | |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Pró-Rata | |
| % Subordinação atual | 100% | |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 26.494.079,95 | |
| Atualização monetária | R\$ 175.837,82 | |
| Saldo Corrigido | R\$ 26.669.917,78 | |
| Amortização Unitario | R\$ 0,00 | |
| Saldo Final | R\$ 27.505.667,01 | |
| Juros Unitário | R\$ 4.697,35 | |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | R\$ 0,00 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 305.037.381,17 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 8.958.438,89 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 45.199,96 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 135.384,84 | |
| BNDU | R\$ 534.147,93 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 295.364.209,55 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 136.759,94 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 67.503,19 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 55.530,56 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 123.033,75 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 123.033,75 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 13.503,40 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 131.114,11 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 51.670,85 | |
| Despesas | -R\$ 22.519,91 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 68.210,48 | |
| Saldo Final | R\$ 2.216,27 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 8.958.438,89 | 39 |
| b - Sdo. dev. em dia | 3.779.615,40 | 23 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 532.650,22 | 1 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 152.517,63 | 1 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | - | 0 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 83.839,89 | 1 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 4.409.815,75 | 13 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | - |
| i - Valores a processar | - | - |
| Posição de Cobrança - BNDU Parcelado | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 45.199,96 | 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. | 45.199,96 | 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 | 0,00% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 7,66% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 6,83% | > 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. | | |