

Série 262
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/05/2020

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------------------------|--------------|
| Tipo Série | Sênior | |
| 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 31/5/2020 | | |
| Duration (CRI) | 2,07 | |
| Rating Atual | A+ | |
| LTV (médio ponderado) | 43,3% | |
| Regime (Pró-rata, sequencial ou sequencial definitivo) | Pró-Rata | |
| % Subordinação atual | 100% | |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 11.728.926,89 | |
| Atualização monetária | R\$ 94.100,91 | |
| Saldo Corrigido | R\$ 11.823.027,80 | |
| Amortização Unitário | R\$ 0,00 | |
| Saldo Final | R\$ 12.193.523,37 | |
| Juros Unitário | R\$ 32.715,41 | |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | R\$ 0,00 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 135.744.497,80 | |
| Saldo devedor total da carteira | R\$ 8.783.415,01 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 372.678,11 | |
| BNDU | R\$ 767.290,38 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 125.821.114,30 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 183.208,32 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 116.277,42 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 41.289,14 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 157.566,56 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 157.566,56 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 377.580,84 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 147.240,12 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 359.869,52 | |
| Despesas | -R\$ 15.228,38 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 146.593,45 | |
| Saldo Final | R\$ 3.129,61 | |
| Posição de Cobrança | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 8.783.415,01 | 45 |
| b - Sdo. dev. em dia | 3.963.911,63 | 21 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 75.339,72 | 1 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias. | 871.197,73 | 9 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 572.208,08 | 6 |
| f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 3.300.757,85 | 8 |
| g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | 2.091,71 | 1 |
| h - Valores a processar | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 23% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 0,00% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 7,97% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 6,22% | > 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. | | |