

| Série 262 Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities 30/09/2020 | | |
|---|--------------------------------|--------------|
| 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 30/9/2020 | | |
| Duration (CRI) | 2,07 | |
| Rating Atual | A+ | |
| LTV (médio ponderado) | 37,6% | |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Pró-Rata | |
| % Subordinação atual | 100% | |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 13.820.458,58 | |
| Atualização monetária | R\$ 379.255,95 | |
| Saldo Corrigido | R\$ 14.199.714,53 | |
| Amortização Unitário | R\$ 0,00 | |
| Saldo Final | R\$ 14.644.687,80 | |
| Juros Unitário | R\$ 7.954,70 | |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | R\$ 0,00 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 165.078.691,49 | |
| Saldo devedor total da carteira | R\$ 8.281.672,32 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 212.669,84 | |
| BNDU | R\$ 760.190,38 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 155.824.158,95 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 186.575,76 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 59.652,67 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 94.826,84 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 154.479,51 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 154.479,51 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 6.893,53 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 151.290,01 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 87.501,66 | |
| Despesas | -R\$ 18.706,11 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 41.000,00 | |
| Saldo Final | R\$ 10.975,77 | |
| Posição de Cobrança | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 8.281.672,32 | 43 |
| b - Sdo. dev. em dia | 3.390.773,07 | 20 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 755.025,38 | 7 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias. | 782.239,61 | 4 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 160.293,74 | 2 |
| f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 3.193.340,52 | 10 |
| g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | 2.091,71 | 1 |
| h - Valores a processar | - | |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 19% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 0,00% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 6,79% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 6,15% | > 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. | | |