

Série 261 E 262
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/03/2018

Dados de emissão da Série		
Tipo Série	Sênior	Júnior
Código Cetip	11J0012950	11J0012951
Código Isin	BRBSCSRI6S8	BRBSCSRI6T6
Data da Emissão	20/10/2011	20/10/2011
Data de Vencimento	20/10/2041	20/10/2041
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	106	11
P.U.	R\$ 300.724	R\$ 321.987
Valor da Emissão	R\$ 31.876.721	R\$ 3.541.858
Juros	8,0000%	44,8125%
Periodicidade Amortização	mensal	mensal
Data da Primeira Amortização	20/12/2011	20/12/2011
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 31/3/2018		
Duration (CRI)	5,21	2,06
Rating Atual	A+	-
LTV (médio ponderado)		42,5%
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	5%	95%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 29.248,36	R\$ 4.896.964,54
Atualização monetária	R\$ 21,40	R\$ 3.583,18
Saldo Corrigido	R\$ 29.269,76	R\$ 4.900.547,72
Amortização Unitario	R\$ 309,12	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 28.960,65	R\$ 4.900.547,72
Juros Unitário	R\$ 188,32	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 3.076.822,50
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 54.499.475,85
Saldo devedor total da carteira		R\$ 10.513.046,84
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 661.396,50
BNDU		R\$ 4.399.370,63
Excedente / (Falta)		-R\$ 42.002.484,38
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês		R\$ 188.559,26
A - Valores recebidos		R\$ 35.828,36
B - Atrasos (meses anteriores)		R\$ 32.096,66
C - Antecipações		R\$ 179.114,24
Valor total Recebido (A + B + C)		R\$ 247.039,26
Créditos a Identificar		R\$ 0,00
Total		R\$ 247.039,26
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial		R\$ 56.467,07
Entradas / Recebimentos		R\$ 370.301,76
Pagamentos CRIs		-R\$ 52.728,69
Despesas		-R\$ 19.841,03
Transferências / Devoluções		R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates		-R\$ 345.000,00
Saldo Final		R\$ 9.199,11
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	10.513.046,84	65
b - Sdo. dev. em dia	3.793.987,70	33
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	2.930.760,29	12
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	1.457.296,94	14
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	177.275,03	2
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	2.153.726,88	4
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	31%	< 10%
% de Reforço de Crédito	22,82%	> 90%
Atraso 180 dias	4,13%	> 7%
Atraso 360 dias	4,13%	> 7%
Pulverização	391%	< 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.