

Série 261 E 262
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/01/2018

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	0
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 31/1/2018		
Duration (CRI)	5,20	2,05
Rating Atual	A+	-
LTV (médio ponderado)	42,2%	
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	6%	94%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 31.208,41	R\$ 4.391.593,47
Atualização monetária	R\$ 276,92	R\$ 38.967,66
Saldo Corrigido	R\$ 31.485,33	R\$ 4.430.561,13
Amortização Unitario	R\$ 405,09	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 31.080,24	R\$ 4.569.400,63
Juros Unitário	R\$ 202,58	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 3.311.131,23
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 50.957.103,73
Saldo devedor total da carteira		R\$ 10.753.986,86
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 394.656,76
BNDU		R\$ 4.540.765,83
Excedente / (Falta)		-R\$ 38.578.825,51
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês		R\$ 229.012,37
A - Valores recebidos		R\$ 120.227,08
B - Atrasos (meses anteriores)		R\$ 174.513,77
C - Antecipações		R\$ 68.263,67
Valor total Recebido (A + B + C)		R\$ 363.004,52
Créditos a Identificar		R\$ 0,00
Total		R\$ 363.004,52
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial		R\$ 2.133,51
Entradas / Recebimentos		R\$ 206.968,74
Pagamentos CRIs		-R\$ 64.412,79
Despesas		-R\$ 1.025,81
Transferências / Devoluções		R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates		-R\$ 100.000,00
Saldo Final		R\$ 43.663,65
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	10.753.986,86	68
b - Sdo. dev. em dia	2.986.220,82	32
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	2.852.688,75	16
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	2.643.921,16	14
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	224.897,51	3
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	2.046.258,62	3
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	68.626,89	1
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	32%	< 10%
% de Reforço de Crédito	24,26%	> 90%
Atraso 180 dias	4,13%	> 7%
Atraso 360 dias	4,13%	> 7%
Pulverização	412%	< 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.