

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
29/03/2020

Dados de emissão da Série		
Tipo Série	Sênior	Júnior
Código Cetip	11D0026633	11D0026636
Código Isin	BRBSCSRI5L5	BRBSCSRI5M3
Data da Emissão	20/04/2011	20/04/2011
Data de Vencimento	20/03/2041	20/03/2041
Vencimento (meses)	364	364
Indexador	IGPM Mensal	IGPM Mensal
Periodicidade Indexador	mensal	mensal
Agente Fiduciário	Oliveira Trust	Oliveira Trust
Agência de Rating	FITCH	-
Rating na Emissão	A+	-
Quantidade	64	7
P.U.	R\$ 302.527	R\$ 307.329
Valor da Emissão	R\$ 19.361.737	R\$ 2.151.304
Juros	8,0000%	45,5904%
Periodicidade Amortização	mensal	mensal
Data da Primeira Amortização	20/07/2011	20/07/2011
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 29/3/2020		
Duration (CRI)	6,28	2,23
Rating Atual	BBB+	-
LTV (médio ponderado)	28,3%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	2%	98%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 27.743,94	R\$ 11.231.572,58
Atualização monetária	-11.27605741	-4564,883779
Saldo Corrigido	R\$ 27.732,66	R\$ 11.227.007,70
Amortização Unitario	R\$ 686,69	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 27.045,97	R\$ 11.583.996,13
Juros Unitário	R\$ 178,43	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 1.742.768,57	
Saldo atual dos CRI Junior	-R\$ 82.366.212,73	
Saldo devedor total da carteira	R\$ 4.788.395,79	
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 129.149,87	
BNDU	R\$ 1.667.606,90	
Excedente / (Falta)	-R\$ 77.523.828,74	
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 83.375,15	
A - Valores recebidos	R\$ 29.546,75	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 18.365,64	
C - Antecipações	R\$ 0,00	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 47.912,39	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 47.912,39	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 3.706,38	
Entradas / Recebimentos	R\$ 49.430,68	
Pagamentos CRIs	-R\$ 55.367,93	
Despesas	-R\$ 11.911,80	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	R\$ 24.000,00	
Saldo Final	R\$ 9.857,33	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	4.788.395,79	28
b - Sdo. dev. em dia	1.282.693,22	15
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	219.100,19	1
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	1.960.054,52	8
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	1.241.370,95	3
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	85.176,91	1
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	18%	< 10%
% de Reforço de Crédito	27,06%	> 90%
Atraso 180 dias	0,24%	> 7%
Atraso 360 dias	0,24%	> 7%
Pulverização	298%	< 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.		