

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/10/2019

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 31/10/2019		
Duration (CRI)	6,33	2,24
Rating Atual	BBB+	-
LTV (médio ponderado)	28,9%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	5%	95%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 50.898,20	R\$ 9.272.802,68
Atualização monetária	-2.764696514	-503.6815589
Saldo Corrigido	R\$ 50.895,44	R\$ 9.272.299,00
Amortização Unitario	R\$ 801,58	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 50.093,86	R\$ 9.567.132,99
Juros Unitário	R\$ 327,46	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 3.221.248,01
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 67.885.192,78
Saldo devedor total da carteira		R\$ 4.725.079,19
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 296.767,36
BNDU		R\$ 3.695.769,08
Excedente / (Falta)		-R\$ 62.388.825,16
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 82.378,57	
A - Valores recebidos	R\$ 23.037,70	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 34.779,96	
C - Antecipações	R\$ 20.159,84	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 77.977,50	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 77.977,50	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 11.580,64	
Entradas / Recebimentos	R\$ 102.886,63	
Pagamentos CRIs	-R\$ 72.258,66	
Despesas	-R\$ 12.446,57	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	-R\$ 21.522,63	
Saldo Final	R\$ 8.231,81	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	4.725.079,19	27
b - Sdo. dev. em dia	1.034.265,93	11
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	2.779.197,01	9
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	543.034,97	5
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	368.581,28	2
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	25%	< 10%
% de Reforço de Crédito	38,59%	> 90%
Atraso 180 dias	1,07%	> 7%
Atraso 360 dias	0,25%	> 7%
Pulverização	224%	< 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.		