

Série 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/01/2024

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------|--------------------------------|
| Tipo Série | | Júnior |
| Código Cetip | | 11D0026636 |
| Código Isin | | BRBSCSRI5M3 |
| Data da Emissão | | 20/04/2011 |
| Data de Vencimento | | 20/03/2041 |
| Vencimento (meses) | | 364 |
| Indexador | | IGPM Mensal |
| Periodicidade Indexador | | mensal |
| Agente Fiduciário | | Oliveira Trust |
| Agência de Rating | | - |
| Rating na Emissão | | - |
| Quantidade | | 7 |
| P.U. | | R\$ 307.329 |
| Valor da Emissão | | R\$ 2.151.304 |
| Juros | | 45,5904% |
| Periodicidade Amortização | | mensal |
| Data da Primeira Amortização | | 20/07/2011 |
| Forma de amortização | | Fixo |
| % Subordinação | | 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 31/1/2024 | | |
| Duration (CRI) | | 2,25 |
| Rating Atual | | - |
| LTV (médio ponderado) | | 43,0% |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | | Sequencial |
| % Subordinação atual | | 100% |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | | R\$ 68.467.792,80 |
| Atualização monetária | | R\$ 506.661,67 |
| Saldo Corrigido | | R\$ 68.974.454,47 |
| Amortização Unitario | | R\$ 0,00 |
| Saldo Final | | R\$ 71.167.657,18 |
| Juros Unitário | | R\$ 10.508,01 |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | | R\$ 0,00 |
| Saldo atual dos CRI Junior | | -R\$ 503.870.356,84 |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | | R\$ 4.465.818,12 |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | | R\$ 0,00 |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | | R\$ 131.240,87 |
| BNDU | | R\$ 569.786,49 |
| Excedente / (Falta) | | -R\$ 498.703.511,36 |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | | R\$ 68.107,18 |
| A - Valores recebidos | | R\$ 18.797,84 |
| B - Atrasos (meses anteriores) | | R\$ 28.563,81 |
| C - Antecipações | | R\$ 0,00 |
| Valor total Recebido (A + B + C) | | R\$ 47.361,65 |
| Créditos a Identificar | | R\$ 0,00 |
| Total | | R\$ 47.361,65 |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | | R\$ 5.839,38 |
| Entradas / Recebimentos | | R\$ 40.423,19 |
| Pagamentos CRIs | | -R\$ 73.556,07 |
| Despesas | | -R\$ 7.741,18 |
| Transferências / Devoluções | | R\$ 0,00 |
| (Aplicações) / Resgates | | R\$ 36.678,15 |
| Saldo Final | | R\$ 1.643,47 |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 4.465.818,12 | 15 |
| b - Sdo. dev. em dia | 624.503,31 | 5 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 1.547.972,21 | 3 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 176.445,92 | 2 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 0,00 | 0 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 96.067,26 | 1 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 2.020.829,42 | 4 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | - |
| i - Valores a processar | - | - |
| Posição de Cobrança - BNDU Parcelado | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 0,00 | 0 |
| b - Sdo. dev. em dia | 0,00 | 0 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 0,00 | 0 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | 0,00 | 0 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 0,00 | 0 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 0,00 | 0 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 0,00 | 0 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | - |
| i - Valores a processar | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 0% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 0,00% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 3,83% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 3,24% | > 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. | | |