

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/08/2020

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 31/8/2020		
Duration (CRI)	6,28	2,25
Rating Atual	BBB+	-
LTV (médio ponderado)	28,5%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	2%	98%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 25.287,27	R\$ 13.645.842,59
Atualização monetária	563.3582135	304006,6745
Saldo Corrigido	R\$ 25.850,62	R\$ 13.949.849,26
Amortização Unitario	R\$ 961,04	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 24.889,59	R\$ 14.393.416,68
Juros Unitário	R\$ 166,32	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 1.612.489,82
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 102.895.578,75
Saldo devedor total da carteira		R\$ 4.861.039,56
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 314.182,03
BNDU		R\$ 1.447.185,59
Excedente / (Falta)		-R\$ 97.885.661,39
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 84.441,29	
A - Valores recebidos	R\$ 85.026,68	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 87.486,37	
C - Antecipações	R\$ 5.380,10	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 177.893,15	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 177.893,15	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 9.512,95	
Entradas / Recebimentos	R\$ 237.274,69	
Pagamentos CRIs	-R\$ 72.150,91	
Despesas	-R\$ 9.791,38	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	-R\$ 162.000,00	
Saldo Final	R\$ 2.845,35	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	4.861.039,56	27
b - Sdo. dev. em dia	1.351.844,65	14
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	463.692,93	4
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	1.597.537,14	5
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	1.447.964,84	4
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	17%	< 10%
% de Reforço de Crédito	31,20%	> 90%
Atraso 180 dias	3,71%	> 7%
Atraso 360 dias	0,22%	> 7%
Pulverização	267%	< 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.		