

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/03/2018

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 31/3/2018		
Duration (CRI)	6,46	2,25
Rating Atual	BBB+	-
LTV (médio ponderado)		42,2%
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	16%	84%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 99.189,83	R\$ 4.751.125,58
Atualização monetária	R\$ 72,58	R\$ 3.476,47
Saldo Corrigido	R\$ 99.262,41	R\$ 4.754.602,06
Amortização Unitario	R\$ 443,90	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 98.818,50	R\$ 4.754.602,06
Juros Unitário	R\$ 638,66	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 6.338.793,31
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 33.653.948,93
Saldo devedor total da carteira		R\$ 6.622.719,75
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 2.439.752,24
BNDU		R\$ 2.797.907,50
Excedente / (Falta)		-R\$ 28.132.362,75
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês		R\$ 103.961,79
A - Valores recebidos		R\$ 13.803,86
B - Atrasos (meses anteriores)		R\$ 17.224,98
C - Antecipações		R\$ 0,00
Valor total Recebido (A + B + C)		R\$ 31.028,84
Créditos a Identificar		R\$ 0,00
Total		R\$ 31.028,84
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial		R\$ 12.527,47
Entradas / Recebimentos		R\$ 2.210.257,43
Pagamentos CRIs		-R\$ 69.283,76
Despesas		-R\$ 12.161,55
Transferências / Devoluções		R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates		-R\$ 2.092.323,83
Saldo Final		R\$ 49.015,76
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	6.622.719,75	35
b - Sdo. dev. em dia	3.063.391,67	19
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	613.455,78	4
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	1.949.345,25	8
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	996.527,05	4
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	38%	< 10%
% de Reforço de Crédito	58,32%	> 90%
Atraso 180 dias	3,20%	> 7%
Atraso 360 dias	2,93%	> 7%
Pulverização	153%	< 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.