

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/01/2018

Dados de emissão da Série		
Tipo Série	Sênior	Júnior
Código Cetip	11D0026633	11D0026636
Código Isin	BRBSCSCR15L5	BRBSCSCR15M3
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 31/1/2018		
Duration (CRI)	6,47	2,24
Rating Atual	A-	-
LTV (médio ponderado)	42,2%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	17%	83%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 98.540,50	R\$ 4.255.102,45
Atualização monetária	R\$ 874,37	R\$ 37.756,54
Saldo Corrigido	R\$ 99.414,87	R\$ 4.292.859,00
Amortização Unitario	R\$ 436,33	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 98.978,54	R\$ 4.429.360,28
Juros Unitário	R\$ 639,64	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 6.366.594,04
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 31.438.416,28
Saldo devedor total da carteira		R\$ 6.574.441,18
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 306.540,06
BNDU		R\$ 4.981.975,81
Excedente / (Falta)		-R\$ 25.942.053,27
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês		R\$ 101.306,23
A - Valores recebidos		R\$ 47.291,27
B - Atrasos (meses anteriores)		R\$ 41.499,77
C - Antecipações		R\$ 0,00
Valor total Recebido (A + B + C)		R\$ 88.791,04
Créditos a Identificar		R\$ 0,00
Total		R\$ 88.791,04
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial		R\$ 20.033,36
Entradas / Recebimentos		R\$ 85.065,05
Pagamentos CRIs		-R\$ 68.862,09
Despesas		-R\$ 853,31
Transferências / Devoluções		R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates		R\$ 0,00
Saldo Final		R\$ 35.383,01
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	6.574.441,18	35
b - Sdo. dev. em dia	2.828.112,95	22
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	1.415.353,52	4
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	577.507,20	4
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	774.848,63	1
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	978.618,88	4
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltadas	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	39%	< 10%
% de Reforço de Crédito	58,52%	> 90%
Atraso 180 dias	3,20%	> 7%
Atraso 360 dias	2,93%	> 7%
Pulverização	171%	< 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.