

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/10/2020

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 31/10/2020		
Duration (CRI)	6,27	2,25
Rating Atual	BBB+	-
LTV (médio ponderado)	28,8%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	1%	99%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 22.241,20	R\$ 15.258.627,11
Atualização monetária	965.444854	662345,7028
Saldo Corrigido	R\$ 23.206,64	R\$ 15.920.972,81
Amortização Unitario	R\$ 262,99	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 22.943,66	R\$ 16.427.216,62
Juros Unitário	R\$ 149,31	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 1.489.002,12
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 117.638.696,59
Saldo devedor total da carteira		R\$ 5.126.685,84
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 139.981,61
BNDU		R\$ 1.447.185,59
Excedente / (Falta)		-R\$ 112.413.845,67
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 89.949,26	
A - Valores recebidos	R\$ 35.031,80	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 29.920,12	
C - Antecipações	R\$ 0,00	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 64.951,92	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 64.951,92	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 11.689,90	
Entradas / Recebimentos	R\$ 61.281,34	
Pagamentos CRIs	-R\$ 26.387,08	
Despesas	-R\$ 18.959,55	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	-R\$ 25.000,00	
Saldo Final	R\$ 2.624,61	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	5.126.685,84	27
b - Sdo. dev. em dia	1.910.335,71	18
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	-	0
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	444.332,23	4
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	1.348.613,35	2
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	1.423.404,55	3
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	16%	< 10%
% de Reforço de Crédito	28,16%	> 90%
Atraso 180 dias	3,38%	> 7%
Atraso 360 dias	0,20%	> 7%
Pulverização	294%	< 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.