

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/07/2023

| Dados de emissão da Série | | |
|---|--------------------------------|--------------|
| Tipo Série | Única | |
| Código Cetip | 11D0026636 | |
| Código Isin | BRBSCSCRI5M3 | |
| 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 | 20/11/2011 | |
| Forma de amortização | Fixo | |
| % Subordinação | 100% | |
| 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 31/7/2023 | | |
| Duration (CRI) | 2,26 | |
| Rating Atual | - | |
| LTV (médio ponderado) | 40,6% | |
| Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo) | Sequencial | |
| % Subordinação atual | 100% | |
| Movimentações/Eventos no mês | | |
| Saldo Anterior | R\$ 57.577.275,61 | |
| Atualização monetária | -R\$ 1.111.169,16 | |
| Saldo Corrigido | R\$ 56.466.106,44 | |
| Amortização Unitario | R\$ 0,00 | |
| Saldo Final | R\$ 58.261.575,66 | |
| Juros Unitário | R\$ 7.149,35 | |
| Ativo x Passivo | | |
| Saldo atual dos CRI Seniors | R\$ 0,00 | |
| Saldo atual dos CRI Junior | -R\$ 411.289.554,88 | |
| Saldo devedor total da carteira - Créditos Ativos | R\$ 4.562.456,50 | |
| Saldo devedor total da carteira - BNDU Parcelado | R\$ 0,00 | |
| Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações | R\$ 299.657,10 | |
| BNDU | R\$ 569.786,49 | |
| Excedente / (Falta) | -R\$ 405.857.654,79 | |
| Posição de Recebimento | | |
| Cobrança do mês | R\$ 68.667,36 | |
| A - Valores recebidos | R\$ 13.552,54 | |
| B - Atrasos (meses anteriores) | R\$ 44.000,84 | |
| C - Antecipações | R\$ 0,00 | |
| Valor total Recebido (A + B + C) | R\$ 57.553,38 | |
| Créditos a Identificar | R\$ 0,00 | |
| Total | R\$ 57.553,38 | |
| Movimentações em Conta da Série | | |
| Saldo Inicial | R\$ 3.011,44 | |
| Entradas / Recebimentos | R\$ 216.604,46 | |
| Pagamentos CRIs | -R\$ 50.045,42 | |
| Despesas | -R\$ 23.893,24 | |
| Transferências / Devoluções | R\$ 0,00 | |
| (Aplicações) / Resgates | -R\$ 144.486,26 | |
| Saldo Final | R\$ 4.477,68 | |
| Posição de Cobrança - Créditos Ativos | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | 4.562.456,50 | 15 |
| b - Sdo. dev. em dia | 1.923.083,74 | 7 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | 401.771,44 | 2 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | - | 0 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | 287.671,39 | 2 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | 289.259,85 | 1 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | 1.660.670,08 | 3 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 0 |
| i - Valores a processar | - | - |
| Posição de Cobrança - BNDU Parcelado | | |
| | | Nº Contratos |
| a - Sdo. dev. total da carteira | - | 0 |
| b - Sdo. dev. em dia | - | 0 |
| c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias. | - | 0 |
| d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 60 dias. | - | 0 |
| e - Sdo. dev. com atraso entre 61 e 90 dias. | - | 0 |
| f - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias. | - | 0 |
| g - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias. | - | 0 |
| h - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados | - | 0 |
| i - Valores a processar | - | - |
| Regras do Regime de Pagamento | | |
| Aceleração de Pagamento | 10% | < 10% |
| % de Reforço de Crédito | 0,00% | > 90% |
| Atraso 180 dias | 3,21% | > 7% |
| Atraso 360 dias | 3,21% | > 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. | | |