

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
30/06/2020

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	
Esriturador	Itaú Corretora de Valores S.A.	
Coordenador da Oferta	0	
Regime Fiduciário	Sim	
Garantias	Alienação Fiduciária	
Dados em 30/6/2020		
Duration (CRI)	6,30	2,25
Rating Atual	BBB+	-
LTV (médio ponderado)		28,3%
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	2%	98%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 26.666,07	R\$ 12.585.984,23
Atualização monetária	74,67586427	35245,88664
Saldo Corrigido	R\$ 26.740,75	R\$ 12.621.230,12
Amortização Unitario	R\$ 216,48	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 26.524,27	R\$ 13.022.551,05
Juros Unitário	R\$ 172,05	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors		-R\$ 1.709.969,76
Saldo atual dos CRI Junior		-R\$ 92.589.598,74
Saldo devedor total da carteira		R\$ 4.788.318,48
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações		R\$ 204.645,54
BNDU		R\$ 1.667.606,90
Excedente / (Falta)		-R\$ 87.638.997,58
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês		R\$ 81.858,76
A - Valores recebidos		R\$ 32.471,71
B - Atrasos (meses anteriores)		R\$ 88.537,09
C - Antecipações		R\$ 0,00
Valor total Recebido (A + B + C)		R\$ 121.008,80
Créditos a Identificar		R\$ 0,00
Total		R\$ 121.008,80
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial		R\$ 20.240,28
Entradas / Recebimentos		R\$ 128.122,47
Pagamentos CRIs		-R\$ 24.865,76
Despesas		-R\$ 11.382,31
Transferências / Devoluções		R\$ 0,00
(Aplicações) / Resgates		-R\$ 108.000,00
Saldo Final		R\$ 4.114,68
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	4.788.318,48	28
b - Sdo. dev. em dia	1.527.053,60	17
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	278.115,68	2
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	1.592.522,82	5
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	-	0
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	1.390.626,38	4
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	-	0
h - Valores a processar	-	-
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	18%	< 10%
% de Reforço de Crédito	32,68%	> 90%
Atraso 180 dias	3,74%	> 7%
Atraso 360 dias	0,23%	> 7%
Pulverização	256%	< 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.