

Série 226 E 227
Relatório de Performance - CRI Brazilian Securities
31/03/2019

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 31/3/2019		
Duration (CRI)	6,37	2,24
Rating Atual	BBB+	-
LTV (médio ponderado)	38,3%	-
Regime (Prórata, sequencial ou sequencial definitivo)	Sequencial Definitivo	Sequencial Definitivo
% Subordinação atual	6%	94%
Movimentações/Eventos no mês		
Saldo Anterior	R\$ 55.076,08	R\$ 7.155.737,29
Atualização monetária	487,246696	63305,32771
Saldo Corrigido	R\$ 55.563,33	R\$ 7.219.042,62
Amortização Unitário	R\$ 740,72	R\$ 0,00
Saldo Final	R\$ 54.822,61	R\$ 7.448.588,62
Juros Unitário	R\$ 357,50	R\$ 0,00
Ativo x Passivo		
Saldo atual dos CRI Seniors	-R\$ 3.532.763,53	
Saldo atual dos CRI Junior	-R\$ 52.964.202,07	
Saldo devedor total da carteira	R\$ 5.445.787,20	
Conta Corrente + Fundo de Reserva + Aplicações	R\$ 163.297,96	
BNDU	R\$ 3.302.777,08	
Excedente / (Falta)	-R\$ 47.585.103,36	
Posição de Recebimento		
Cobrança do mês	R\$ 90.347,27	
A - Valores recebidos	R\$ 65.093,83	
B - Atrasos (meses anteriores)	R\$ 52.202,74	
C - Antecipações	R\$ 0,00	
Valor total Recebido (A + B + C)	R\$ 117.296,57	
Créditos a Identificar	R\$ 0,00	
Total	R\$ 117.296,57	
Movimentações em Conta da Série		
Saldo Inicial	R\$ 21.205,46	
Entradas / Recebimentos	R\$ 94.339,47	
Pagamentos CRIs	-R\$ 70.285,90	
Despesas	-R\$ 6.496,43	
Transferências / Devoluções	R\$ 0,00	
(Aplicações) / Resgates	-R\$ 36.000,00	
Saldo Final	R\$ 2.762,60	
Posição de Cobrança		
		Nº Contratos
a - Sdo. dev. total da carteira	5.445.787,20	29
b - Sdo. dev. em dia	3.557.169,74	17
c - Sdo. dev. com atraso de até 30 dias.	329.243,26	3
d - Sdo. dev. com atraso entre 31 e 90 dias.	545.632,46	5
e - Sdo. dev. com atraso entre 91 e 180 dias.	464.928,31	2
f - Sdo. dev. com atraso superior de 180 dias.	548.813,43	2
g - Sdo. dev. dos clientes com Parcelas Saltados	208.222,13	1
h - Valores a processar	-	
Regras do Regime de Pagamento		
Aceleração de Pagamento	27%	< 10%
% de Reforço de Crédito	42,15%	> 90%
Atraso 180 dias	1,64%	> 7%
Atraso 360 dias	1,64%	> 7%
Pulverização	203%	< 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.		