

Performa Real Estate - Fundo de Investimento Imobiliário (PEMA11)



Relatório Mensal Fevereiro | 2024

O Fundo PEMA11 foi constituído para realizar investimentos em cotas subordinadas de CRI. As cotas subordinadas dos CRI distribuem recursos quando existir excedentes de ativos após o cumprimento das obrigações perante os CRI Seniores. Este Fundo não realizará reinvestimentos, portanto os valores recebidos serão integralmente distribuídos aos cotistas do Fundo.

Informações gerais do Fundo	
Mês do Relatório	Fevereiro/2024
Número de Cotas	552.000
Número de Cotistas	373
Valor Patrimonial	R\$39.281.549
Valor Patrimonial por Cota	R\$ 71,162
Distribuição do Mês por Cota	R\$0,3647

RELAÇÃO ANALÍTICA DOS CRI

Dezembro/2023

										Informações Contábeis		Informações Gerenciais			
Emissor	Ativo	CRI	SÉRIE	Indexador	Qte Total	Qtde Fundo PEMA11	Regime de Pgto	VP CRI SR	Receíveis	Saldo em Caixa (último dia do mês)	Valor dos bens retomados	Vlr. de Avaliação	Atraso não contabilizado (*)	Valor de Venda BNDU a 70%	Diferença da Venda de bens retomados (**)
1 Brazilian Securities	10I0020235	181	Júnior	IGPM	21	10	Exclusivo	-	6.197.522	429.769	1.371.084	2.035.000	407.577	1.424.500	53.416
2 Brazilian Securities	10K0024721	186-187	Sênior e Júnior	IGPM	4	1	Pró-Rata	(3.419.915)	2.714.067	41.404	240.712	500.000	251.871	350.000	109.288
3 Brazilian Securities	10L0027046	194-195	Sênior e Júnior	IGPM	7	3	Pró-Rata	(8.197.314)	3.560.674	68.819	69.345	188.000	2.213.735	131.600	62.255
4 Brazilian Securities	11A0022964	199-200	Sênior e Júnior	IGPM	9	4	Sequencial	(2.256.798)	317.355	15.017	716.450	949.000	30.717	664.300	(52.150)
5 Brazilian Securities	11A0027577	202	Júnior	IGPM	15	6	Exclusivo	-	17.923.492	85.973	87.842	350.000	6.380.090	245.000	157.158
6 Brazilian Securities	11C0034567	217-218	Sênior e Júnior	IGPM	4	1	Sequencial Definitivo	-	5.065.226	30.098	772.952	1.233.000	408.025	863.100	90.148
7 Brazilian Securities	11C0034300	219-220	Sênior e Júnior	IGPM	7	3	Sequencial	(495.983)	1.618.754	47.111	280.000	350.000	470.169	245.000	(35.000)
8 Brazilian Securities	11C0035214	222	Júnior	IGPM	3	1	Exclusivo	-	1.151.127	11.426	268.398	1.000.000	18.673	700.000	431.602
9 Brazilian Securities	11D0026636	227	Júnior	IGPM	7	3	Exclusivo	-	4.451.089	170.856	569.786	1.045.000	1.169.506	731.500	161.714
10 Brazilian Securities	11E0026005	234	Júnior	IGPM	7	3	Exclusivo	-	3.403.205	45.554	584.041	1.550.000	685.784	1.085.000	500.959
11 Brazilian Securities	11F0034536	240-241	Sênior e Júnior	IGPM	4	2	Sequencial	(836.917)	3.145.330	29.101	165.191	639.000	1.034.410	447.300	282.109
12 Brazilian Securities	11F0039678	243	Júnior	PRE	6	2	Exclusivo	-	3.639.338	48.366	1.238.209	3.042.000	2.084.468	2.129.400	891.191
13 Brazilian Securities	11F0039956	246	Júnior	IGPM	18	8	Exclusivo	-	1.748.755	752.826	1.226.783	2.736.000	1.662.849	1.915.200	688.418
14 Brazilian Securities	11H0020280	253-254	Sênior e Júnior	IGPM	8	3	Sequencial Definitivo	-	11.028.497	336.532	505.179	1.183.000	1.303.578	828.100	322.921
15 Brazilian Securities	11H0022435	255-256	Sênior e Júnior	PRE	16	7	Sequencial	(2.730.614)	4.830.271	440.532	110.058	530.000	998.813	371.000	260.942
16 Brazilian Securities	11I0017007	258	Júnior	IGPM	4	1	Exclusivo	-	5.220.870	37.165	564.025	970.000	1.179.313	679.000	114.975
17 Brazilian Securities	11I0019327	259-260	Sênior e Júnior	IGPM	5	3	Sequencial	(4.991.680)	1.280.474	625.176	1.054.750	1.702.000	76.648	1.191.400	136.650
18 Brazilian Securities	11J0012951	262	Júnior	IGPM	11	6	Exclusivo	-	7.185.759	203.616	469.700	1.035.000	812.814	724.500	254.800
19 Brazilian Securities	11J0018310	264	Júnior	PRE	12	6	Exclusivo	-	1.537.935	96.956	1.401.986	1.994.000	638	1.395.800	(6.186)
20 Brazilian Securities	11K0018243	269-270	Sênior e Júnior	IGPM	9	5	Sequencial Definitivo	(3.174.953)	7.676.936	216.078	3.021.816	3.911.000	727.571	2.737.700	(284.116)
21 Brazilian Securities	11L0019395	275	Júnior	IGPM	9	2	Exclusivo	-	9.668.533	57.958	941.949	1.410.000	2.815.457	987.000	45.051
22 Brazilian Securities	11L0019402	277	Júnior	PRE	7	4	Exclusivo	-	286.785	71.796	167.200	312.000	99	218.400	51.200
TOTAL									(26.104.175)	103.651.993	3.862.128	15.827.457	24.732.805	20.064.800	4.237.343

(*) Valor potencial total esperado quando da recuperação do respectivo atraso, se houver.
(**) Valor potencial total esperado na venda dos Bens Retomados, em função do seu valor de avaliação (premissa 70%), em comparação ao valor contábil.

Os valores apurados são baseados nas informações recebidas da Securitizadora ou disponibilizados no site, com defasagem de dois meses da divulgação do Relatório.

PRINCIPAIS CARACTERÍSTICAS DOS CRI

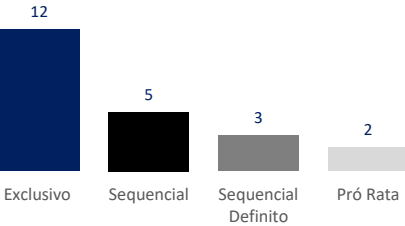
Tipo de Indexação CRI

Indexador	Total
IGP-M	18
Pré-Fixado	4



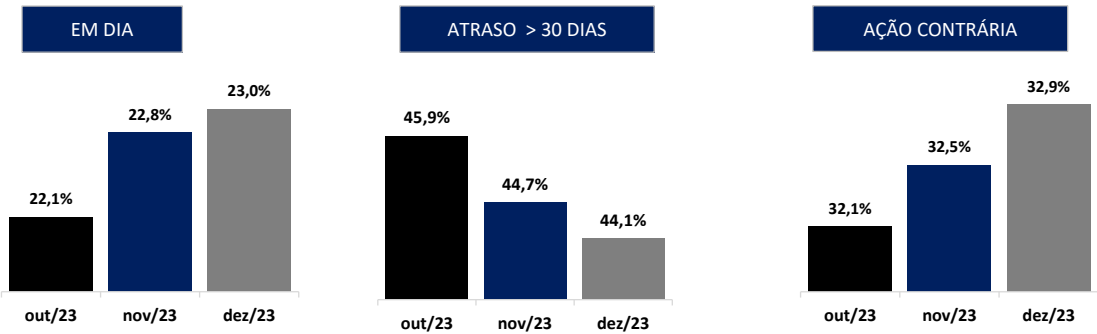
Regime de Pagamento

Regime	Total
Exclusivo	12
Sequencial	5
Sequencial Definitivo	3
Pró Rata	2



INADIMPLÊNCIA FECHAMENTO DEZ/23

Distribuição da Carteira por Faixa de Atraso

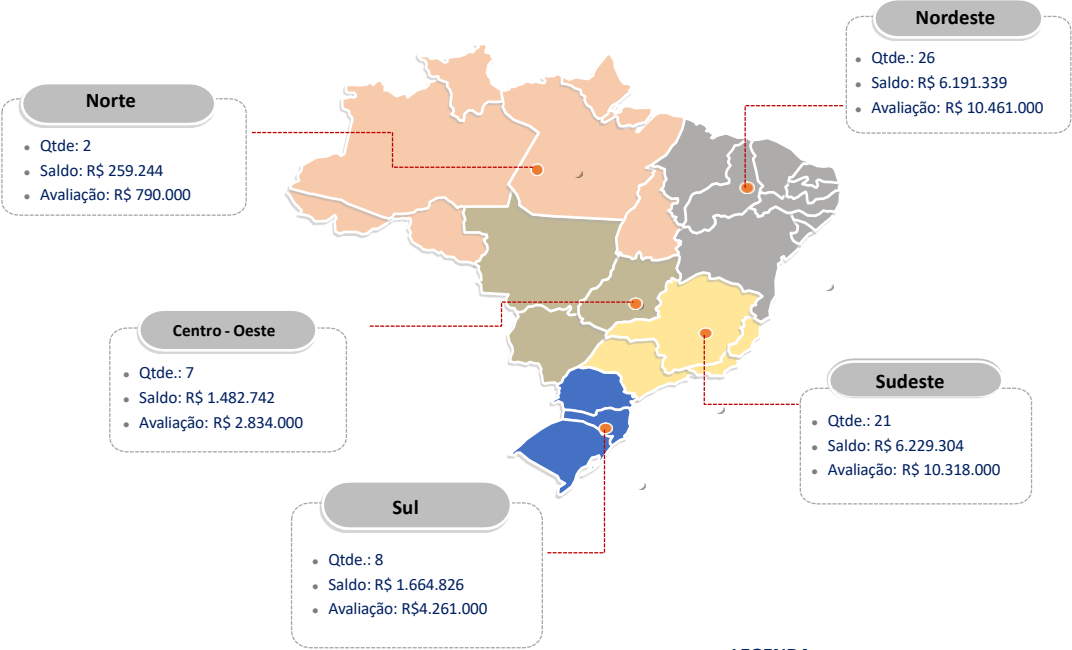


Fonte: Brazilian Securities Companhia de Securitização. As informações são recebidas com defasagem de dois meses da divulgação do relatório.

Legenda Gráfico Regime de Pagamento

- Exclusivo:** Pagamento somente dos CRI Júnior (JR) (CRI Sênior (SR) Liquidado).
- Sequencial:** Pagamento somente dos CRI SR atendendo aos critérios de apuração. Os CRI JR terão seus pagamentos suspensos temporariamente e seus juros incorporados mensalmente ao saldo devedor durante todo período.
- Sequencial Definitivo:** Pagamento somente dos CRI SR. Os pagamentos das obrigações relativas as séries dos CRI Júnior estão sujeitas ao pagamento integral das séries de CRI Sênior.
- Pró Rata:** Pagamento dos CRI SR e JR atendendo aos critérios dispostos no Termo de Securitização.

DISTRIBUIÇÃO GEOGRÁFICA DOS BENS RETOMADOS (SALDOS CONTÁBEIS - DEZ/23)



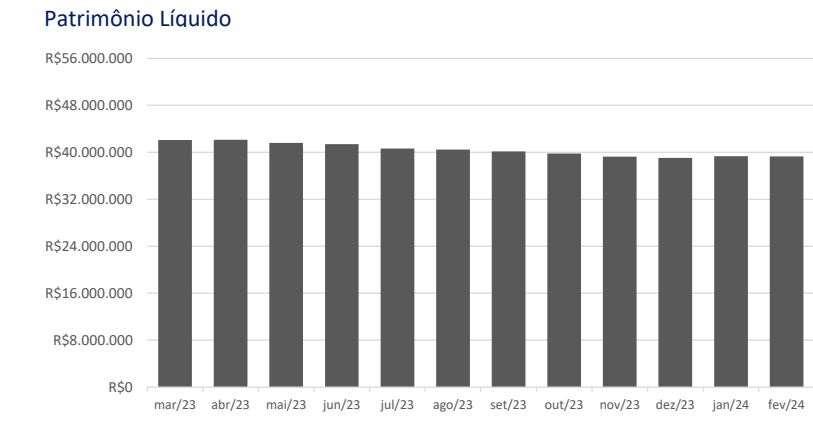
LEGENDA
Qtde.: quantidade de imóveis
Saldo: valor do saldo contábil
Avaliação: valor de avaliação contábil

POSIÇÃO GERAL ATIVOS E PASSIVOS

Dezembro/2023	
PASSIVO	Dezembro/23
VP CRI Sênior	R\$26.104.175
AJUSTE	R\$5.332.452
TOTAL	R\$20.771.723
ATIVOS Contábil	
VP da Carteira	R\$103.651.993
Caixa	R\$3.862.128
Valor contábil dos bens retomados	R\$15.827.457
TOTAL	R\$123.341.577
ATIVOS Gerencial	
Diferença da Venda de bens retomados (*)	R\$4.237.343
Atraso não contabilizado (**)	R\$24.732.805
TOTAL	R\$28.970.148
TOTAL DE ATIVOS	R\$152.311.725,28
SOMA DOS ATIVOS PARA PGT CRI JR	R\$131.540.002,67
SOMA DOS ATIVOS DO FUNDO (PEMA11)	R\$52.004.916,96

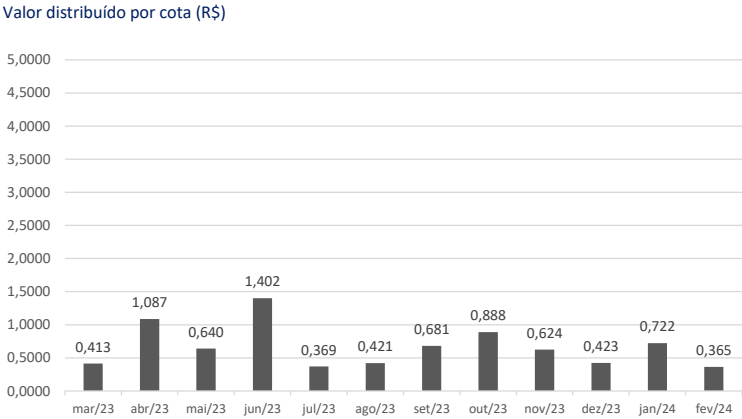
LEGENDA
(*) Valor potencial total esperado na venda dos Bens Retomados, em função do seu valor de avaliação (premissa 70%), em comparação ao valor contábil.
(**) Valor potencial total esperado quando da recuperação do respectivo atraso, se houver.

INFORMAÇÕES DO FUNDO PERFORMA

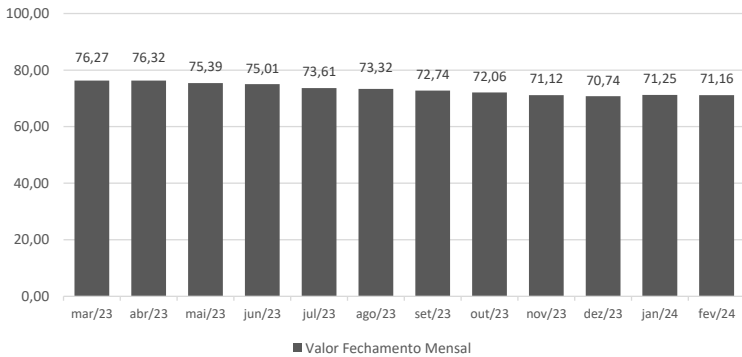


Fonte: CVM, Documento Informe Estruturado (Periodicidade Mensal) e Documento Rendimento e Amortizações

Distribuição Mensal em R\$



Valor da cota no fechamento do mês



10. DISCLAIMERS

A Axis Serviços Financeiros atua como prestadora de serviços contratada pelo Fundo, para fins de acompanhamento dos CRI e geração de informações gerenciais complementares. A Axis não atua como Gestor ou Administrador de qualquer ativo.

As informações utilizadas para geração deste relatório foram prestadas pela Securitizadora ou coletadas no site da CVM. Não garantimos a acuracidade das informações recebidas, que pode sofrer alteração a qualquer tempo.

As informações contidas neste relatório são meramente informativas, não devendo ser consideradas como uma opinião ou indicação de compra ou venda de qualquer ativo. Não foram consideradas eventuais provisões ou outras situações não previstas. Algumas informações são estimativas baseadas em determinadas premissas. A sua utilização precisa considerar o contexto definido pela respectiva premissa.

É importante destacar que a rentabilidade alvo não representa e nem deve ser considerada, sob qualquer hipótese, como promessa, garantia ou sugestão de rentabilidade ou isenção de risco para os cotistas.

