

CAPITÂNIA SECURITIES II FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII

CNPJ nº 18.979.895/0001-13– Código de Negociação B3: CPTS11

CARTA DO GESTOR

Na qualidade de gestor do CPTS11 e diante dos últimos acontecimentos que impactaram o mercado de CRIs e, conseqüentemente, os fundos imobiliários de CRIs, vimos por meio deste comunicado informar que **o fundo não possui exposição direta ou indireta a CRIs do segmento de loteamento, hotelaria, multipropriedade ou ao “Circuito das Compras”**, assim como participação acionária em qualquer um destes.

Em 28 de fevereiro de 2023 o fundo contava com exposição a 47 séries de CRI conforme tabela abaixo e que possuem as seguintes características:

- 100% da carteira está adimplente, performando de acordo com o esperado;
- 94,7% da carteira de CRI tem como devedor final empresas e/ou fundos imobiliários listados, preponderantemente dos segmentos de Shopping, Logística, Renda Urbana e Lajes Corporativas;
- 91,3% da carteira de CRI possui alienação fiduciária de imóvel, com LTV médio ponderado defensivo de 56,9% com base no último laudo;
- 95,0% da carteira de CRI possui cessão fiduciária de recebíveis de aluguéis.

Por último, **não há nesta data quaisquer conversas sobre pedidos de carência e/ou extensão de prazos dos CRIs da carteira que sejam de conhecimento do gestor.**

Estamos à disposição para quaisquer esclarecimentos nos canais de RI: invest@capitaniainvestimentos.com.br

Ativo	Código B3	Devedor Principal	Segmento	Volume (R\$)	% Ativos	LTV
CRI GTIS True 447S 1E	21J0043571	FII GTIS Brazil Logistics	Logístico/Industrial	278,543,575	8.7%	54.1%
CRI GSFI True 236S 1E	20G0800227	FII General Shopping	Shopping	196,440,448	6.1%	47.1%
CRI HBR ComVem Habitasec 242S 1E	21G0507867	HBR	Varejo	121,805,359	3.8%	85.4%
CRI TRX Assaí II Bari 98S 1E	21K0665223	Assaí	Varejo	110,427,910	3.5%	76.9%
CRI Gazit True Sec 340S 1E	21E0407810	FII Gazit Malls	Shopping	107,663,307	3.4%	N/A
CRI Vinci Shoppings Virgo 366S 4E	21I0682465	FII Vinci Shoppings	Shopping	102,324,441	3.2%	67.3%
CRI Leo Madeiras Opea Sec 1E 423S	22A0699149	Leo Madeiras	Logístico/Industrial	101,399,044	3.2%	66.2%
CRI Pátio Malzoni Virgo 329S 4E	21I0931497	Pátio Malzoni	Comercial	96,619,005	3.0%	68.8%
CRI Via Varejo Extrema Habitasec 1E 258S	21G0864354	Via Varejo	Logístico/Industrial	86,502,913	2.7%	81.3%
CRI BTLG Mauá RB Sec 466S 1E	21L0640489	FII BTG Pactual Log,	Logístico/Industrial	72,711,492	2.3%	22.6%
CRI Rede D'Or RBSec 397S 1E	21K0001807	Rede D'Or	Hospital	64,036,028	2.0%	N/A
CRI Grupo Mateus Barisec 1E 105S	22D0371159	Grupo Mateus	Varejo	60,941,747	1.9%	54.6%
CRI Vinci Renda Urbana Virgo 280S 4E	21G0093703	FII Vinci Renda Urbana	Educacional	53,338,280	1.7%	64.4%
CRI BRF PE Isec 99S 4E	21A0709253	BRF	Logístico/Industrial	52,405,050	1.6%	49.2%
CRI Campinas Shopping Virgo 2S 65E	22K1362572	Campinas Shopping	Shopping	50,931,811	1.6%	33.3%
Jequitibá Plaza Shop CRI Habita 259S 1E	21F1076965	Jequitibá Plaza Shop.	Shopping	50,334,248	1.6%	67.8%
CRI Vinci Log Castelo RB Sec 472S 1E	22A0377996	FII Vinci Logística	Logístico/Industrial	48,670,708	1.5%	44.2%
CRI Grupo Mateus Opea 1S 38E	22H1631360	Grupo Mateus	Logístico/Industrial	46,304,547	1.4%	80.2%
CRI Grupo Mateus Barisec 1S 3E	22F0783752	Grupo Mateus	Varejo	39,939,966	1.3%	54.0%
CRI HBR Habitasec 148S 1E	19G0228153	HBR	Comercial	35,986,271	1.1%	70.9%
CRI Athena I Virgo 4E 335S	21H0700312	FII Athena I	Comercial	32,979,252	1.0%	72.0%
CRI Verticale RB Sec 383S 1E	21I0277499	Grupo Verticale	Varejo	30,393,089	1.0%	42.3%
CRI Pernambucanas Opea 1S 52E	22K0640841	Pernambucanas	Varejo	30,098,764	0.9%	N/A
CRI Sanema Opea 1S 34E	22G0701494	Sanema	Infraestrutura	29,779,537	0.9%	80.5%
CRI Makro RB Sec 422S 1E	21L0666509	Makro	Varejo	25,972,065	0.8%	58.4%
CRI Galleria Bank True 1S 7E	22E0640809	Galleria Bank	Residencial	25,253,975	0.8%	18.5%

CRI DutraLog TrueSec 401S 1E	21F1076305	FII DutraLog	Logístico/Industrial	24,197,499	0.8%	56.7%
CRI Hedge Desev. Log Habitasec 13E 2S	22I0089943	FII Hedge Desev. Log	Logístico/Industrial	23,846,080	0.7%	65.9%
CRI Pulverizado Extrema III Habita 1S 19E	22K0024321	Pulverizado	Logístico/Industrial	22,287,232	0.7%	102.8%
CRI Madureira Shopping RBSec 468S 1E	21L0736589	FII Malls Brasil Plural	Shopping	18,819,339	0.6%	30.5%
FII Unidades Autônomas	IDF111	Helbor	Residencial	17,819,350	0.6%	74.9%
CRI Via Varejo Extrema Habitasec 1E 286S	21J0585266	Via Varejo	Logístico/Industrial	17,010,940	0.5%	83.1%
CRI HSI Logística 1S 55E	22J0978863	FII HSI Logística	Logístico/Industrial	15,537,251	0.5%	119.5%
CRI GPA RBVA True 346S 1E	20L0687133	GPA	Varejo	14,185,738	0.4%	82.5%
CRI Corporativo Grupo Mateus True 1S 3E	22C1362141	Grupo Mateus	Varejo	13,177,645	0.4%	N/A
CRI Pulverizado Extrema IV Habita 1S 23E	22L1464124	Pulverizado	Logístico/Industrial	9,874,959	0.3%	100.7%
CRI São Carlos Truesec 1S 50E	22E1314836	São Carlos	Comercial	8,618,241	0.3%	N/A
CRI Hedge Desev. Log Habitasec 12E 1S	22I0089753	FII Hedge Desev. Log	Logístico/Industrial	7,882,519	0.2%	65.1%
CRI Hedge Design Offices Virgo 2S 29E	22K0016415	FII Hedge Design Office	Comercial	7,644,067	0.2%	43.0%
CRI Hedge Viracopos True 477S 1E	21L0354209	FII Hedge Logística	Logístico/Industrial	5,585,989	0.2%	51.9%
CRI Hedge Viracopos True 478S 1E	21L0355069	FII Hedge Logística	Logístico/Industrial	5,332,366	0.2%	51.9%
CRI XP Industrial True 446S 1E	21J0790766	FII XP Industrial	Logístico/Industrial	4,222,280	0.1%	97.8%
CRI Hedge Desev. Log Habitasec 13E 1S	22I0089914	FII Hedge Desev. Log	Logístico/Industrial	3,971,209	0.1%	66.1%
CRI Hedge Desev. Log Habitasec 12E 2S	22I0089805	FII Hedge Desev. Log	Logístico/Industrial	3,965,819	0.1%	65.6%
CRI Grupo AIZ Isec 302S 4E	21F0569265	Grupo AIZ	Logístico/Industrial	2,514,636	0.1%	35.3%
CRI Vinci Logística Habitasec 132S 1E	19A0093844	FII Vinci Logística	Logístico/Industrial	896,897	0.0%	20.2%
CRI Campinas Shopping Virgo 1S 65E	22K1361155	Campinas Shopping	Shopping	259,478	0.0%	33.3%
				2,179,452,368	68.2%	55.2%