

São Paulo, 14 de agosto de 2023

À

Comissão de Valores Mobiliários

GIES – Gerência de Investimentos Estruturados

Ref. Demonstrativo Trimestral de Fundo de Investimento em Direitos Creditórios

Em atendimento ao disposto no §3º do artigo 8º da Instrução CVM Nº 356, de 17 de dezembro de 2001, serve o presente para encaminhar:

DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL – 2º TRIMESTRE DE 2023 FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS – RBR I CNPJ: 38.472.268/0001-07

1. Informações da Carteira do Fundo e cumprimento da Alocação Mínima de Investimentos em Direitos Creditórios:

Composição da Carteira em 30/06/23			
RBR I FIDC	R\$	Base	% Ref.
1.Total Recebíveis	17.577.412,44	PL	95,64%
1.a) Recebíveis a vencer	17.577.412,44	-	
1.b) Recebíveis Vencidos		-	
1.c) PDD		-	
2. Outros Ativos	805.719,24	PL	4,38%
3. Contas a Pagar e Receber	(3.959,33)	PL	-0,02%
4. PL Total	18.379.172,35	PL	100,00%

O percentual do Fundo em Direitos Creditórios no último dia útil do trimestre em referência foi de 95,64%. O percentual médio de Direitos Creditórios na carteira do Fundo no trimestre foi de 93,23%.

O Fundo manteve-se enquadrado durante o trimestre e suas aplicações financeiras e aquisições de direitos creditórios observaram a política de investimento descrita no Regulamento do Fundo, e os limites aplicáveis.

2. Informações sobre as cessões de Direitos Creditórios realizadas e das taxas praticadas em cada cessão no período:

No 2º trimestre de 2023, foi realizada a aquisição de Direito(s) Creditório(s) pelo Fundo, conforme os dados da tabela anexa ao presente Demonstrativo Trimestral (Anexo I). Informamos que a aquisição de direitos creditórios efetuada durante o trimestre em questão foi realizada em caráter definitivo.

3. Informações sobre as aplicações do Fundo e evidência das taxas de mercado nas negociações:

Aplicações do Fundo:

As operações praticadas pelo Fundo no período estiveram em consonância com a política de investimento prevista em seu regulamento e com os limites de composição e de diversificação a ele aplicáveis. A parcela remanescente do patrimônio líquido do Fundo que não estiver alocada em Direitos de Crédito poderá ser aplicada, isolada ou cumulativamente, na aquisição dos seguintes Ativos Financeiros:

- I. Títulos de emissão do Tesouro Nacional;
- II. Títulos de emissão do Banco Central do Brasil;
- III. Operações compromissadas com lastro nos ativos mencionados nos itens (i) e (ii) acima;
- IV. Certificados de depósito bancário, de instituições que tenha classificação de risco equivalente a “AAA”, em escala nacional, atribuída por agência de classificação de risco habilitada para atuar no país; e
- V. Cotas de fundos de investimento que invistam exclusivamente nos ativos mencionados nos itens (i), (ii), (iii) e (iv) acima, os quais poderão ser administrados e/ou geridos pela Administradora, Gestora, Consultor Especializado, Custodiante ou quaisquer de suas partes relacionadas, tal como definidas pelas regras contábeis que tratam do assunto.

Taxa de Mercado nas negociações do Fundo:

As aquisições de Direitos Creditórios realizadas pelo Fundo, inclusive as taxas aplicadas nas cessões, estão disponíveis no Anexo I do presente Demonstrativo Trimestral. Os Outros Ativos do Fundo são negociados conforme taxas de mercado vigentes.

4. Procedimentos realizados e resultado da verificação de lastro dos Direitos Creditórios:

Nos termos do Regulamento do Fundo, o Custodiante é responsável por realizar a verificação de lastro por amostragem. Nesse sentido, o Custodiante informou o resultado da verificação realizada, conforme o que segue:

I. Quantidade de créditos a vencer analisados: o Custodiante informou que realizou a verificação da documentação de lastro dos créditos a vencer, referentes às operações realizadas pelo Fundo, tendo analisado 2 (dois) direitos creditórios, dos quais foram verificados 100% (cem por cento) da documentação de lastro da aquisição realizada pelo Fundo.

II. Quantidade de créditos inadimplidos e substituídos analisados e o percentual de representatividade na carteira: O Custodiante informou que não houve direitos creditórios vencidos e/ou substituídos no trimestre em análise.

III. A quantidade de créditos inexistentes verificados, se houver: O Custodiante informou que não foram verificados direitos creditórios inexistentes.

IV. Outras inconsistências encontradas, caso aplicável: O Custodiante informou que não foram verificadas quaisquer inconsistências com relação à documentação de lastro dos Direitos Creditórios.

V. Medidas adotadas pelo Administrador para regularizar eventuais inconsistências encontradas: Não foram identificadas inconsistências, e portanto, não foi necessária a atuação do Administrador neste sentido.

5. Informações sobre a natureza dos Direitos Creditórios e documentos representativos de crédito:

As informações sobre a natureza dos Direitos Creditórios passíveis de aquisição pelo Fundo, bem como seus documentos e/ou instrumentos representativos de crédito, estão descritas no item 4 e seguintes do Regulamento do Fundo.

6. Informações sobre os mecanismos e procedimentos de cobrança de Direitos Creditórios:

As informações sobre os mecanismos e procedimentos de cobrança dos Direitos Creditórios que porventura venham a inadimplir, estão descritas na Política de Cobrança de Direitos Creditórios Inadimplidos, presente no Anexo III do Regulamento do Fundo.

7. Informações sobre os originadores que possuem concentração igual ou superior a 10% da carteira do Fundo:

Os critérios e informações sobre a política de concessão de crédito estão descritas no Anexo II do Regulamento do Fundo. Informamos também que não ocorreram alterações quanto ao critério de concessão de crédito do Fundo no trimestre em questão.

8. Eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de ativos:

Informamos que não ocorreram alterações nas garantias existentes para o conjunto de ativos que compõe a carteira do Fundo no trimestre em questão.

9. Informações sobre eventos de pré-pagamento ocorridos no período:

Informamos que durante o trimestre em questão não houve eventos de pré-pagamentos.

10. Informações sobre as alienações de Direitos Creditórios pelo Fundo:

Informamos que durante o trimestre em questão não foram realizadas alienações.

11. Informações sobre as Substituições de Direitos Creditórios no trimestre:

Informamos que durante o trimestre em questão não foram realizadas substituições.

12. Informações sobre fatos ocorridos que afetaram a regularidade dos fluxos de pagamento previstos:

Não ocorreram fatos que afetassem a regularidade dos fluxos de pagamentos previstos no trimestre em questão.

13. Informações complementares:

Não há informações complementares a serem divulgadas para o trimestre em questão.

Ariana Renata Pavan
Diretora de Administração Fiduciária

FRAM CAPITAL DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

ANEXO I – TABELA DE AQUISIÇÕES DE DIREITOS CREDITÓRIOS

RBR FIDC		
Data da Cessão	Valor de Compra	Taxa de Remuneração
25/04/2023	1.999.078,78	CDI + 5%
30/05/2023	2.181.900,87	CDI + 5%