

DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL

Relatório Trimestral – 30/09/2024

À Comissão de Valores Mobiliários - CVM

Prezados senhores,

O Banco Daycoval S.A. ("Administrador"), CNPJ 62.232.889/0001-90, na qualidade de administrador do RIO BRAVO INLIRA STEFANINI CONSÓRCIO FIDC DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, CNPJ/ME Nº 55.711.648/0001-68, disciplinado pela Resolução CMN 2.907, pela Instrução CVM 175 e alterações posteriores, apresenta as informações relativas ao 3º trimestre de 2024:

1. OBJETIVO DO FUNDO E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A Classe tem como objetivo proporcionar aos Cotistas a valorização das suas Cotas por meio da aplicação de recursos, preponderantemente, nos Direitos Creditórios, observada a política de investimento da Classe.

2. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

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.

- Composição da carteira na data base (30/09/2024):

Carteira	Valor	% do PL
Caixa	R\$ 1.000,00	0,45%
Contas a Pagar/Receber	R\$ 123.324,24	56,59%
Valores Mobiliários	R\$ 93.572,86	42,94%

3. PROCEDIMENTO DE VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS DIREITOS CREDITÓRIOS

Os Documentos Comprobatórios compreenderão a documentação necessária para o exercício das prerrogativas decorrentes da titularidade dos Direitos Creditórios Cedidos, tais como o protesto, a cobrança ou a execução judicial, sendo capazes de comprovar a origem, a existência e a exigibilidade dos Direitos Creditórios Cedidos, sem prejuízo da possibilidade de aquisição pela Classe de Direitos Creditórios não performados.

1. Parâmetros para a verificação do lastro dos Direitos Creditórios Cedidos por amostragem

Observado o disposto no artigo 20, inciso VII, do Anexo Normativo II da Resolução CVM 175, bem como o item 7.7 e 7.7.1 do Regulamento, a verificação do lastro dos Direitos Creditórios Cedidos com Preço de Aquisição inferior a R\$25.000,00 (vinte e cinco mil reais) será realizada por amostragem.

2. Metodologia para a verificação do lastro dos Direitos Creditórios Cedidos por amostragem

Procedimento A

Obtenção de base de dados analítica por recebível junto à Gestora, à Consultoria InLira e à Consultoria BRBB, para seleção de uma amostra de itens para fins de verificação dos Documentos Comprobatórios dos Direitos Creditórios Cedidos com Preço de Aquisição inferior a R\$25.000,00 (vinte e cinco mil reais).

Procedimento B

Seleção de uma amostra aleatória de itens a serem verificados. A seleção dos Direitos Creditórios Cedidos será obtida de forma aleatória: (i) dividindo-se o tamanho da população (N) pelo tamanho da amostra (n), obtendo um intervalo de retirada (K); (ii) sorteia-se o ponto de partida; e (c) a cada K elementos, será retirada uma amostra. Caso a Classe possua (i) até 03 (três) Cotistas, haverá uma mostra de 25 (vinte e cinco) itens; (ii) mais de 03 (três) Cotistas, haverá uma amostra de 50 (cinquenta) itens.

Procedimento C

Verificação dos documentos representativos dos Direitos Creditórios Cedidos, isto é, os Documentos Comprobatórios.

Procedimento D

$$n = \frac{N * z^2 * p * (1 - p)}{ME^2 * (N - 1) + z^2 * p * (1 - p)}$$

Onde:

(i) Classe com apenas 1 (um) Cotista titular de Cotas Juniores, 0 (zero) outros e 0 (zero)

resgate e/ou amortização:

n = tamanho da amostra;

N = totalidade de Direitos Creditórios Cedidos;

z = Cristal Score = 1,96 (um inteiro e noventa e seis centésimos);

p = produção a ser estimada = 50% (cinquenta por cento);

ME = erro médio = 5,6% (cinco inteiros e seis décimos por cento); e

(ii) Classe com mais de 1 (um) Cotista titular de Cotas Juniores e/ou outros ou com apenas 1 (um) cotista subordinado, 0 (zero) outros e 1 (um ou mais) resgate e/ou amortização:

n = tamanho da amostra;

N = totalidade de Direitos Creditórios Cedidos;

z = Cristal Score = 1,96 (um inteiro e noventa e seis centésimos);

p = produção a ser estimada = 50% (cinquenta por cento);

ME = erro médio = 9,8% (nove inteiros e oito décimos por cento).

Base de Seleção e Critério de Seleção

A população base para a seleção da amostra compreenderá os Direitos Creditórios Cedidos em aberto (vencidos e a vencer) e Direitos Creditórios Cedidos recomprados no trimestre de referência.

A seleção dos Direitos Creditórios Cedidos será obtida da seguinte forma: (i) para os 5 (cinco) Cedentes mais representativos em aberto na carteira e para os 5 (cinco) Cedentes mais representativos que tiverem títulos recomprados serão selecionados os 3 (três) Direitos Creditórios Cedidos de maior valor; (ii) adicionalmente serão selecionados os demais itens para completar a quantidade total de itens da amostra.

Foi utilizada a data base de 30/08/2024.

3.1 DOS RESULTADOS APRESENTADOS

i) Direitos Creditórios a Vencer:

O Fundo não possui direitos creditórios adquiridos no trimestre.

ii) Direitos Creditórios Vencidos/Substituídos:

O Fundo não possui direitos creditórios vencidos e/ou substituídos no trimestre.

3.2 DOS REGISTROS DE DIREITOS CREDITÓRIOS

i) Direitos Creditórios Registrados:

Direito Creditório	Registrados	% Carteira	% PL
Não aplicável	-	-	-

i) Direitos Creditórios Não Registrados:

Direito Creditório	Não Registrados	% Carteira	% PL
Não aplicável	-	-	-

4. AÇÕES JUDICIAIS, PROCESSOS ADMINISTRATIVOS OU ARBITRAIS

Durante o trimestre em referência, não houve ações judiciais, processos administrativos ou arbitrais.

Atenciosamente,

BANCO DAYCOVAL S.A.
CNPJ 62.232.889/0001-90
Administrador do Fundo



Demonstrativo Trimestral

RIO BRAVO INLIRA STEFANINI CONSÓRCIO FIDC DE RESPONSABILIDADE LIMITADA.

São Paulo, 13 de novembro de 2024.

Ao

Banco Daycoval S.A.

Em cumprimento ao disposto no Anexo II, capítulo VI da RCVM 175, a RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA. ("Rio Bravo") vem apresentar as informações a seguir para a elaboração do Informe Trimestral de FIDC, especificamente para o fundo RIO BRAVO INLIRA STEFANINI CONSÓRCIO FIDC DE RESPONSABILIDADE LIMITADA. ("Fundo")

Base normativa ("BN"): Anexo I, capítulo VI, artigo 27, inciso V, alíneas "c" e "d":

BN		Rio Bravo
Alínea C. O eventual ajuizamento de ação judicial de cobrança ou propositura de processo administrativo, judicial ou arbitral envolvendo a classe de cotas, bem como a indicação do percentual do patrimônio envolvido e em risco.		
§ 2º A informação de que trata a alínea "c" do inciso V do caput:	I – pode ser dada de forma agregada, caso a quantidade e valores envolvidos nas ações judiciais e arbitrais assim justifiquem; ou	R: Não há.
	II – pode ser omitida do demonstrativo trimestral, a critério do gestor, caso sua divulgação possa prejudicar a estratégia de cobrança ou fomentar a inadimplência de direitos creditórios.	R: Não aplicável, dado a resposta acima.
Alínea D. Informações contidas no relatório trimestral do gestor a que se refere o § 3º deste artigo.		
§ 3º Para efeitos da alínea "d" do	I – os efeitos de eventual alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteira de ativos.	R: Não houve alteração.

Demonstrativo Trimestral

RIO BRAVO INLIRA STEFANINI CONSÓRCIO FIDC DE RESPONSABILIDADE LIMITADA.

inciso V do caput, o gestor deve elaborar e encaminhar ao administrador, em até 40 (quarenta) dias após o encerramento do trimestre civil a que se referir, relatório contendo:	II – em relação aos originadores que representem individualmente 10% (dez por cento) ou mais da carteira de direitos creditórios no trimestre	a) critérios para a concessão de crédito adotados pelos originadores, caso tais critérios não tenham sido descritos no regulamento ou em outros demonstrativos trimestrais;	R: Os critérios constam descritos no respectivo regulamento.
		b) eventuais alterações nos critérios para a concessão de crédito adotados por tais originadores, caso os critérios adotados já tenham sido descritos no regulamento ou em outros demonstrativos trimestrais.	R: Não houve alteração.
	III – eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios.		R: Não houve alteração.
	IV – forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo.	a) descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito, se houver.	R: Aporte de direitos creditórios do cotista subordinado, sendo que foram realizados via cessão da InLira através de boletim de subscrição. Ainda será feita a passagem da posição subordinada para o investidor beneficiário final.
		b) indicação do caráter definitivo, ou não, da	R: Caráter Definitivo.

Demonstrativo Trimestral

RIO BRAVO INLIRA STEFANINI CONSÓRCIO FIDC DE
RESPONSABILIDADE LIMITADA.

		cessão de direitos creditórios.	
	V – impacto dos eventos de pré-pagamento no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira.		R: Não houve pré-pagamento.
	VI – condições de alienação, a qualquer título, de direitos creditórios, incluindo.	a) momento da alienação (antes ou depois do vencimento).	R: Não há, considerando que não foi realizada nenhuma alienação, até o presente momento.
		b) motivação da alienação.	R: Não aplicável, considerando a resposta acima.
	VII – impacto no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira de ativos de uma possível descontinuidade, a qualquer título, da originação ou cessão de direitos creditórios		R: O Fundo não tem parcela relevante de caixa atualmente. Cabe esclarecer que até o momento ocorreu aporte de direitos creditórios apenas na cota subordinada. Neste sentido, se houver descontinuidade total da cota subordinada, os ativos venceriam e retornaríamos os recursos ao investidor.
	VIII – informações sobre fatos ocorridos que afetaram a regularidade dos fluxos financeiros oriundos dos direitos creditórios, incluindo, mas não se limitando, a quaisquer eventos que acarretem na liquidação ou amortização antecipada de direitos creditórios		R: Não há.

Evandro Buccini

Victor F. Tâmega

Evandro Buccini (14 de novembro de 2024 09:11 GMT-3) Victor F. Tâmega (14 de novembro de 2024 09:15 GMT-3)

RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA.

13.11.24-Demonstratito Trimestral - FIDC Consórcio - vf

Relatório de auditoria final

2024-11-14

Criado em:	2024-11-14
Por:	Assinatura Rio Bravo (assinatura.adobe@riobravo.com.br)
Status:	Assinado
ID da transação:	CBJCHBCAABAAO4VM9CYJ_tEpxOFjHAAR2J6a5hrZu98N

Histórico de "13.11.24-Demonstratito Trimestral - FIDC Consórcio - vf"

-  Documento criado por Assinatura Rio Bravo (assinatura.adobe@riobravo.com.br)
2024-11-14 - 12:10:05 GMT- Endereço IP: 200.100.113.102
-  Documento enviado por email para evandro.buccini@riobravo.com.br para assinatura
2024-11-14 - 12:10:10 GMT
-  Documento enviado por email para victor.tamega@riobravo.com.br para assinatura
2024-11-14 - 12:10:10 GMT
-  Email visualizado por evandro.buccini@riobravo.com.br
2024-11-14 - 12:10:38 GMT- Endereço IP: 104.47.55.126
-  O signatário evandro.buccini@riobravo.com.br inseriu o nome Evandro Buccini ao assinar
2024-11-14 - 12:11:05 GMT- Endereço IP: 186.204.58.155
-  Documento assinado eletronicamente por Evandro Buccini (evandro.buccini@riobravo.com.br)
Data da assinatura: 2024-11-14 - 12:11:07 GMT - Fonte da hora: servidor- Endereço IP: 186.204.58.155
-  Email visualizado por victor.tamega@riobravo.com.br
2024-11-14 - 12:14:44 GMT- Endereço IP: 104.47.58.126
-  O signatário victor.tamega@riobravo.com.br inseriu o nome Victor F. Tâmega ao assinar
2024-11-14 - 12:15:04 GMT- Endereço IP: 187.11.114.75
-  Documento assinado eletronicamente por Victor F. Tâmega (victor.tamega@riobravo.com.br)
Data da assinatura: 2024-11-14 - 12:15:06 GMT - Fonte da hora: servidor- Endereço IP: 187.11.114.75
-  Contrato finalizado.
2024-11-14 - 12:15:06 GMT



Adobe Acrobat Sign