



MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

Fevereiro de 2021

Rentabilidades

| | | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Ano | Acum. |
|------|-------|--------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|
| 2009 | Fundo | 0,43% | 0,83% | 0,97% | 0,83% | 0,78% | 0,78% | 0,86% | 0,72% | 0,72% | 0,72% | 0,70% | 0,79% | 9,52% | 9,52% |
| | % CDI | 89,2% | 97,1% | 99,4% | 99,2% | 102,3% | 103,4% | 108,9% | 103,5% | 104,6% | 104,5% | 106,7% | 108,7% | 102,7% | 102,7% |
| 2010 | Fundo | 0,71% | 0,63% | 0,82% | 0,76% | 0,81% | 0,84% | 0,92% | 0,94% | 0,89% | 0,85% | 0,86% | 1,06% | 10,56% | 21,08% |
| | % CDI | 107,4% | 106,8% | 108,6% | 114,3% | 107,4% | 106,7% | 106,6% | 105,7% | 105,4% | 105,1% | 106,5% | 114,4% | 108,3% | 105,8% |
| 2011 | Fundo | 0,86% | 0,90% | 0,97% | 0,86% | 1,03% | 0,99% | 1,03% | 1,15% | 0,99% | 0,94% | 0,92% | 0,98% | 12,26% | 35,92% |
| | % CDI | 100,1% | 106,6% | 105,7% | 101,9% | 104,6% | 104,4% | 106,8% | 107,2% | 105,0% | 106,3% | 107,4% | 108,2% | 105,7% | 106,2% |
| 2012 | Fundo | 0,95% | 0,80% | 0,87% | 0,74% | 0,76% | 0,68% | 0,73% | 0,78% | 0,59% | 0,67% | 0,63% | 0,58% | 9,13% | 48,33% |
| | % CDI | 107,3% | 108,2% | 107,8% | 105,8% | 103,8% | 105,9% | 108,0% | 113,0% | 108,9% | 110,3% | 115,3% | 109,4% | 108,8% | 107,3% |
| 2013 | Fundo | 0,61% | 0,50% | 0,56% | 0,64% | 0,62% | 0,62% | 0,75% | 0,75% | 0,75% | 0,88% | 0,75% | 0,75% | 8,59% | 61,08% |
| | % CDI | 104,8% | 104,0% | 104,3% | 106,2% | 106,0% | 106,0% | 105,0% | 105,6% | 107,4% | 107,6% | 109,4% | 106,3% | 106,7% | 107,6% |
| 2014 | Fundo | 0,92% | 0,82% | 0,80% | 0,86% | 0,85% | 0,87% | 0,99% | 0,89% | 0,98% | 1,03% | 0,92% | 1,05% | 11,55% | 79,68% |
| | % CDI | 110,2% | 105,1% | 105,9% | 105,7% | 98,5% | 106,6% | 105,4% | 103,7% | 108,8% | 109,1% | 109,3% | 109,6% | 106,9% | 108,1% |
| 2015 | Fundo | 1,00% | 0,88% | 1,11% | 1,00% | 1,01% | 1,12% | 1,18% | 1,15% | 1,13% | 1,18% | 1,18% | 1,17% | 13,94% | 104,74% |
| | % CDI | 108,0% | 107,4% | 107,5% | 105,5% | 102,9% | 105,5% | 100,6% | 103,9% | 101,8% | 106,9% | 111,9% | 101,1% | 105,4% | 108,3% |
| 2016 | Fundo | 1,09% | 1,00% | 1,22% | 1,06% | 1,21% | 1,28% | 1,21% | 1,31% | 1,19% | 1,13% | 1,12% | 1,19% | 14,94% | 135,32% |
| | % CDI | 103,2% | 100,3% | 105,1% | 100,2% | 109,3% | 110,1% | 109,0% | 108,0% | 107,4% | 107,3% | 108,1% | 106,0% | 106,7% | 108,9% |
| 2017 | Fundo | 1,20% | 0,99% | 1,12% | 0,81% | 0,99% | 0,86% | 0,83% | 0,85% | 0,66% | 0,66% | 0,56% | 0,56% | 10,57% | 160,19% |
| | % CDI | 110,0% | 113,7% | 106,4% | 103,2% | 106,8% | 105,6% | 103,2% | 106,3% | 103,6% | 102,7% | 99,3% | 104,4% | 106,2% | 109,3% |
| 2018 | Fundo | 0,61% | 0,49% | 0,60% | 0,56% | 0,56% | 0,55% | 0,58% | 0,79% | 0,50% | 0,61% | 0,55% | 0,58% | 7,21% | 178,94% |
| | % CDI | 104,6% | 106,0% | 112,7% | 108,6% | 108,1% | 105,4% | 106,8% | 139,7% | 107,1% | 112,3% | 110,7% | 117,3% | 112,2% | 110,2% |
| 2019 | Fundo | 0,58% | 0,54% | 0,49% | 0,57% | 0,56% | 0,48% | 0,61% | 0,52% | 0,51% | 0,40% | 0,22% | 0,36% | 6,00% | 195,69% |
| | % CDI | 107,2% | 108,7% | 104,5% | 110,6% | 102,5% | 103,3% | 106,7% | 103,7% | 110,0% | 83,3% | 57,9% | 95,9% | 100,6% | 110,0% |
| 2020 | Fundo | 0,42% | 0,35% | -2,73% | -1,34% | 0,62% | 1,76% | 1,21% | 0,74% | 0,52% | 0,39% | 0,46% | 0,39% | 2,75% | 203,83% |
| | % CDI | 112,0% | 118,5% | -801,2% | -471,7% | 259,1% | 818,6% | 624,0% | 461,0% | 328,5% | 249,5% | 310,9% | 236,8% | 99,5% | 109,8% |
| 2021 | Fundo | 0,45% | 0,37% | | | | | | | | | | | | 206,33% |
| | % CDI | 303,7% | 272,2% | | | | | | | | | | | | 110,7% |

Rentabilidades Acumuladas

| Período | Fundo | % CDI |
|-----------------|--------|--------|
| Últim. 3 meses | 1,21% | 270,4% |
| Últim. 6 meses | 2,61% | 285,1% |
| Últim. 12 meses | 2,80% | 118,7% |
| Últim. 18 meses | 5,16% | 107,2% |
| Últim. 24 meses | 8,60% | 106,6% |
| Últim. 30 meses | 12,30% | 108,0% |
| Últim. 36 meses | 16,45% | 109,7% |
| Desde Jan/2009 | 206,3% | 110,7% |

Objetivo do fundo

O Fundo possui como objetivo proporcionar uma rentabilidade superior ao desempenho do CDI, através de operações no mercado de Crédito Privado, mantendo um perfil de atuação arrojado.

Público alvo

Investidores em geral que busquem uma rentabilidade superior ao CDI e uma gestão conservadora dos recursos.

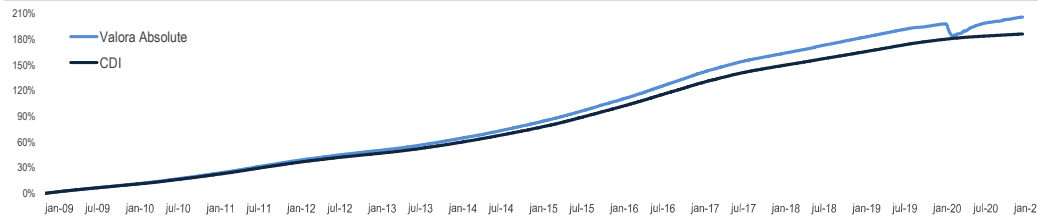
Taxa de administração

0,50% ao ano sobre o patrimônio líquido do Fundo, provisionada diariamente e paga mensalmente. *

Taxa de performance

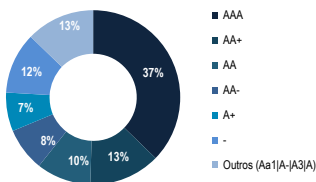
20% sobre o que exceder 100% do CDI (utilizando marca d'água).

Evolução da rentabilidade acumulada (%)

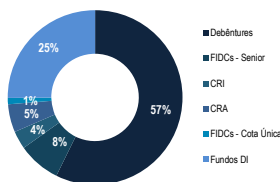


Dados da carteira

CLASSE DE RATING



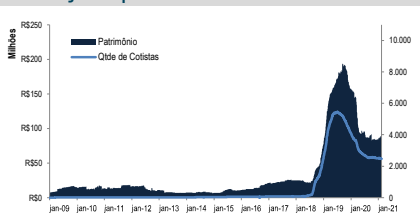
TIPO DE ATIVO



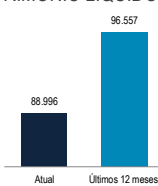
Análise risco x retorno

| Indicadores | Fundo | CDI | Indicadores (Rent Mensal) | % CDI |
|-----------------------------|-------|-------|---------------------------|----------|
| Retorno Médio (Anual) | 9,72% | 9,11% | Maior | 818,60% |
| Volatilidade Média (Anual) | 0,50% | 0,19% | Menor | -801,19% |
| Índice de Sharpe | | 1,22 | Meses > CDI | 135 |
| Índice de Sharpe (12 meses) | 0,28 | | Meses < CDI | 9 |

Informações patrimoniais



PATRIMÔNIO LÍQUIDO - R\$



Gestor
VALORA GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA | CNPJ: 07.559.989/0001-17
Rua Iguaçu nº 448 - Conjunto 1301
Itaim Bibi | São Paulo-SP | CEP: 01451-010
Tel: +55 (11) 3016 0900 | Fax: +55 (11) 3016 0900
www.valorainvest.com.br | ri@valorainvest.com.br

Administrador / distribuidor
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S/A | CNPJ: 02.201.501/0001-61
Av. Presidente Wilson, 231 - 11º andar | Centro | Rio de Janeiro- RJ
CEP: 20030-905 | Tel: +55 (21) 3219-2500 | Fax: +55 (21) 3219-2501
SAC: "Fale Conosco" em www.bnymellon.com.br/sfou
(21) 3219-2600, (11) 3050-8010 | Ouvidoria: ouvidoria@bnymellon.com.br ou 0800 725 3219

Dados adicionais

Gestão: Valora Gestão de Investimentos Ltda.
Administração: BNY Mellon Serv. Financ. DTVM S/A
Custódia: BNY Mellon Serv. Financ. DTVM S/A
Auditoria: KPMG

| | |
|--------------------------|------------------------------------|
| Classificação tributária | Longo Prazo |
| Tipo de cota | Fechamento |
| Divulgação das cotas | Diariamente: CVM e ANBIMA |
| Taxa de entrada / saída | Não há |
| Classificação ANBIMA | RF - Duração Livre - Crédito Livre |
| Classificação CVM | Fundos de Investimento RF CP LP |
| Código Cetip | 0788.0.00-3 |
| Código ISIN | BRABS7CTFO06 |
| Código ANBIMA | 222836 |
| Código GIIN | 7G4P2U.99999.SL.076 |
| Conta Selic | 3463.00.70-7 |

