



### MATERIAL DE DIVULGAÇÃO

Junho 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%  | 0,86%  | 1,06%  | 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%  | 0,62%  | 0,75%  | 0,75%  | 0,75%  | 0,88%  | 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%  | 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%  | 0,40%  | 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%  | 0,39%  | 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%  | 0,47%   | 0,43%   | 0,37%  | 0,43%  |        |        |        |        |        |        | 2,55%   | 211,58% |
|      | % CDI | 303,7% | 272,2% | 236,7%  | 205,4%  | 139,6% | 142,1% |        |        |        |        |        |        | 200,9%  | 111,8%  |

#### Rentabilidades Acumuladas

| Período         | Fundo  | % CDI  |
|-----------------|--------|--------|
| Últim. 3 meses  | 1,24%  | 157,2% |
| Últim. 6 meses  | 2,55%  | 199,5% |
| Últim. 12 meses | 6,42%  | 281,9% |
| Últim. 18 meses | 5,37%  | 132,0% |
| Últim. 24 meses | 8,17%  | 116,9% |
| Últim. 30 meses | 11,70% | 113,9% |
| Últim. 36 meses | 15,79% | 114,9% |
| Desde Jan/2009  | 211,6% | 111,8% |

#### 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).

#### Tributação

Cobrado pela Receita Federal das pessoas físicas e jurídicas. Imposto de Renda: Carteira do Fundo enquadrada como "Longo Prazo" para efeito de tributação.

IOF: resgates efetuados até o 29º dia contado da data da aplicação estão sujeitos a uma alíquota decrescente, conforme tabela publicada na portaria MF no. 264/99.

#### Aplicações

As aplicações serão efetuadas pela cota de fechamento do mesmo dia da efetiva disponibilidade dos recursos, quando solicitadas até às 13:00h para a 1ª aplicação e até às 14:00h para as demais, podendo ser feito através de: TED ou CETIP (D+0).

Aplicação inicial: **R\$ 1.000,00**

Investimento adicional mínimo: **R\$ 1.000,00**

Favorecido: Valora Absolute FIRF Crédito Privado LP

CNPJ: 10.326.625/0001-00

BNY Mellon (17) | Ag. 1 | Conta Corrente: 1783-3

#### Resgates

Prazo de resgate: **15 dias**

Os resgates podem ser solicitados até às 14:00h, sendo pagos no 1º dia útil subsequente à data da conversão de cotas, que ocorre no 14º (décimo quarto) dia corrido após o pedido de resgate.

Resgate mínimo: **R\$ 1.000,00**

#### 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

#### Informações operacionais

Data de início do Fundo: 16-jan-09

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

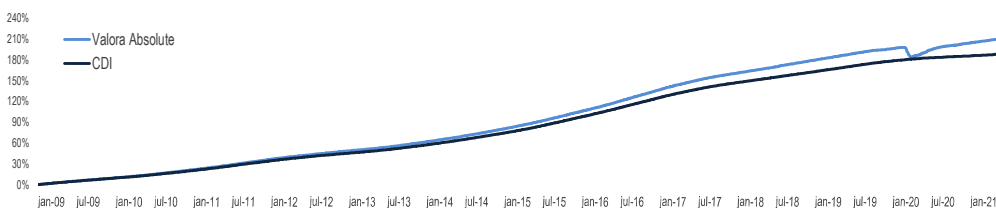
Código ISIN: BRABS7CTF006

Código ANBIMA: 222836

Código GIIN: 7G4P2U.99999.SL.076

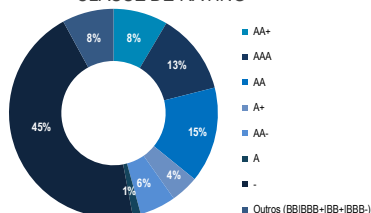
Conta Selic: 3463.00.70-7

#### Evolução da rentabilidade acumulada (%)

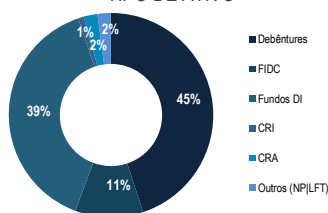


#### Dados da carteira

##### CLASSE DE RATING



##### TIPO DE ATIVO

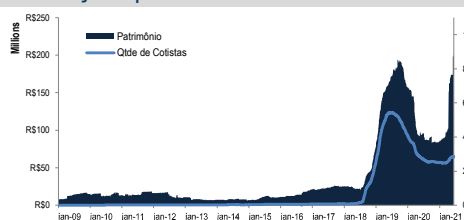


#### Análise risco x retorno

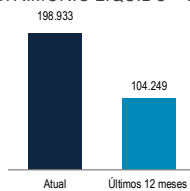
desde Janeiro / 2009

| Indicadores                 | Fundo | CDI   | Indicadores (Rent Mensal) | % CDI    |
|-----------------------------|-------|-------|---------------------------|----------|
| Retorno Médio (Anual)       | 9,59% | 8,94% | Maior                     | 818,60%  |
| Volatilidade Média (Anual)  | 0,49% | 0,20% | Menor                     | -801,19% |
| Índice de Sharpe            | 1,33  |       | Meses > CDI               | 139      |
| Índice de Sharpe (12 meses) | 11,41 |       | Meses < CDI               | 9        |

#### Informações patrimoniais



##### PATRIMÔNIO LÍQUIDO - R\$



**Gestor**  
VALORA GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA | CNPJ: 07.559.989/0001-17  
Rua Iguatemi 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

Esta lâmina emitida pela Valora Gestão de Investimentos Ltda. é um mero informativo e não deve ser considerada uma oferta para compra de cotas do fundo. É recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento pelo investidor ao aplicar seus recursos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. Fundos de Investimentos não contam com a garantia do Administrador do Fundo, do Gestor da Carteira, de qualquer mecanismo de seguro, ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. A taxa de administração prevista acima é a taxa de administração mínima do Fundo. \*Tendo em vista que o Fundo admite a aplicação em cotas de fundos de investimento, fica instituída a taxa de administração máxima de 0,8% a.a. sobre o valor do patrimônio líquido do Fundo. Este fundo utiliza estratégia com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Os fundos de Crédito Privado estão sujeitos a um risco de perda substancial de seu patrimônio líquido em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos integrantes de sua carteira, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo. Data de início do Fundo 16/01/2009. Para a avaliação do fundo, é recomendada a análise de, no mínimo, doze meses. A Administração deste fundo pertence à BNY Mellon. A Valora Gestão de Investimentos Ltda. informa que garante a veracidade de tais informações e afirma que estas estão devidamente atualizadas até a data de fechamento presente neste documento.

