RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

OBJETIVO

Proporcionar aos Cotistas que se enquadrem no Público-Alvo, a valorização de suas Cotas, através da aplicação preponderante dos recursos do FUNDO na aquisição de Direitos de Crédito, representados por CCB, oriundos de Crédito Consignado contratado entre os Devedores e a Ciasprev. Os Devedores são funcionários públicos de Entes Públicos Conveniados.

Julho/2022

INFORMAÇÕES GERAIS

Início do Fundo 15/03/2021 Administrador CM Capital Ltda

Gestor Valora Gestão de Investimentos

Custodiante CM Capital Ltda

Agente de Conta Fiduciária Santander S.A

Rentabilidade Cota Sênior CDI+6,5% a.a.
Rating Cota Sênior 'brA-(sf)'
Prazo de Duração Sênior 114 meses
Prazo de Carência Sênior 18 meses
Vencimento Sênior 04/2031

Rentabilidade Cota Mezanino CDI+8,5% a.a.
Rating Cota Mezanino 'brBBB-(sf)'
Prazo de Duração Mezanino 114 meses
Prazo de Carência Mezanino 18 meses
Vencimento Mezanino 05/2030

Rentabilidade Cota Subordinada Júnior

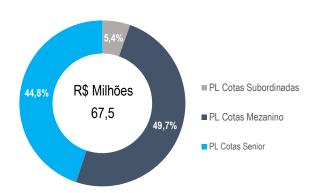
		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2021	Fundo	-	-	-4,36%	0,43%	1,34%	2,52%	2,74%	3,24%	0,86%	0,87%	-0,18%	4,79%	12,65%	12,65%
	%CDI	-	-	-	207%	501%	828%	771%	765%	182%	119%	-	654%	265%	265%
2022	Fundo	0,22%	-1,99%	-1,70%	-0,24%	-0,51%	1,76%	1,97%						-0,56%	12,02%
	%CDI	30%	-	-			173%	191%	-	-		-			112%

Fechamento De Mês (R\$ - Mil)

Valores da planilha em R\$ mil

	ago-21	set-21	out-21	nov-21	dez-21	jan-22	fev-22	mar-22	abr-22	mai-22	jun-22	jul-22
Direitos Creditórios	25.037	25.435	27.684	30.164	32.644	34.405	35.189	35.515	41.800	50.266	54.789	56.801
Caixa (Saldo em Tesouraria)	2	4	4	5	8	22	144	1	90	16	12	6
Títulos Públicos	302	304	306	308	311	313	113	114	115	116	118	119
Cotas de Fundos (Zeragem de Caixa)	203	107	2.203	1.087	1.064	843	2.539	2.890	995	535	1.078	10.704
	ago-21	set-21	out-21	nov-21	dez-21	jan-22	fev-22	mar-22	abr-22	mai-22	jun-22	jul-22
Sênior	-	-	2.005	3.033	5.095	6.263	8.355	8.482	12.603	16.443	19.698	30.251
Mezanino	22.939	23.197	25.482	25.798	26.189	26.561	26.925	27.368	27.766	31.366	33.052	33.556
Subordinada	2.488	2.509	2.531	2.527	2.648	2.653	2.601	2.556	2.550	3.038	3.091	3.662
PL	25.427	25.707	30.018	31.358	33.932	35.477	37.881	38.406	42.920	50.847	55.841	67.469

Patrimônio Líquido e Cotas



Evolução Patrimonial (R\$ milhões)



Indicadores de acompanhamento



	Exigido	Atual	Situação
Atraso F30	<18%	4,79%	Enquadrado
Atraso F60	<15%	4,57%	Enquadrado
Atraso F90	<12%	0,94%	Enquadrado
Índice de Perda Líquida	<8%	0,00%	Enquadrado
Índice de Pré-Pagamento	<8%	0,21%	Enquadrado
Índice de Resolução de Cessão	<3%	0,00%	Enquadrado

As informações contidas neste material são de caráster exclusivamente informativo. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito – FCG. A rentabilidade de fullquád en fundo, sostos. A rentabilidade chida no posasdon alos representa garantia de rentabilidade fullquád en fundo, e recomenda e la fimina de informações essenciais antes de investir. Para avaliação de performance do fundo, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses.

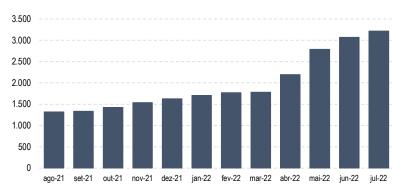
Este conteúdo foi elaborado pelo Gestor com fins meramente informativos, não devendo ser considerado como recomendação de investimento ou oferta para aquisição de cotas, nem servir como base única para tomada de decisão de investimento. Qualsquer outras informações ou escalarecimentos sobre o Fundo poderão ser obtidos omo o Administrador e o Gestor, através do e mail rigiovalorainvest.com.br.



www.valorainvest.com.br +55 11 3016.0900

RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO FIDC ALION CONSIGNADOS

Quantidade de Devedores



PDD e Patrimônio Líquido (R\$ - Mil)



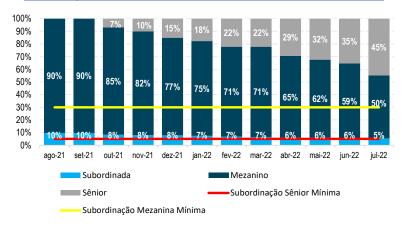
Comportamento das Liquidações dos Títulos



Volume Operado Mensal



Distribuição de Passivo



Taxa Média (a.m.)

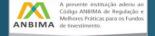


Cronograma de Vencimentos (Acumulado Trimestralmente) - R\$ mil



As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito – FGC. A rentabilidade divigada não é liquida de impostos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Leia o prospecto, o regulamento e a lâmina de informações essenciais antes de investir. Para avaliação de performance do fundo, é recomendavel uma análise de, no mínimo, 12 (30e) meses.

Este conteúdo foi elaborado pelo Gestor com fins meramente informativos, não devendo ser considerado como recomendação de investimento ou oferta para aquisição de cotas, nem servir como base única para tomada de



Duration Da Carteira (Meses)



Crédito Vencido e Não Pago (R\$)



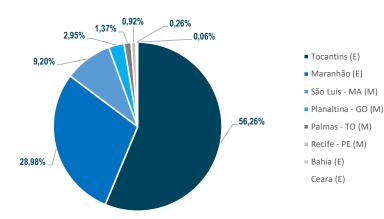
PDD/DC



Crédito Vencido e Não Pago/DC



Concentração por Ente Público Conveniado/DC



Concentração por Idade/DC

