

RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

Julho/2022

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.

INFORMAÇÕES GERAIS

Início do Fundo	15/03/2021	Rentabilidade Cota Sênior	CDI+6,5% a.a.	Rentabilidade Cota Mezanino	CDI+8,5% a.a.
Administrador	CM Capital Ltda	Rating Cota Sênior	'brA-(sf)'	Rating Cota Mezanino	'brBBB-(sf)'
Gestor	Valora Gestão de Investimentos	Prazo de Duração Sênior	114 meses	Prazo de Duração Mezanino	114 meses
Custodiante	CM Capital Ltda	Prazo de Carência Sênior	18 meses	Prazo de Carência Mezanino	18 meses
Agente de Conta Fiduciária	Santander S.A	Vencimento Sênior	04/2031	Vencimento Mezanino	05/2030

Rentabilidade Cota Subordinada Júnior

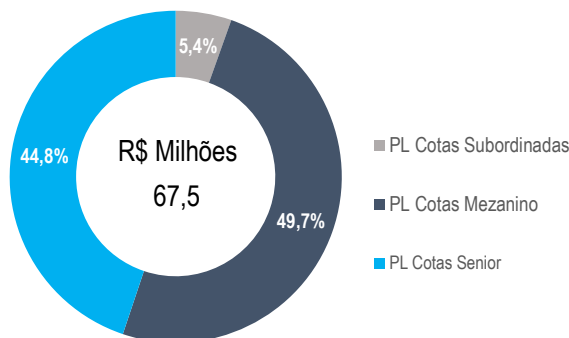
		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2021	Fundo	-	-	-4,36%	0,43%	1,34%	2,52%	2,74%	3,24%	0,86%	0,87%	-0,18%	4,79%	12,65%	12,65%
	%CDI	-	-	-	207%	501%	828%	771%	765%	182%	119%	-	654%	265%	265%
2022	Fundo	0,22%	-1,99%	-1,70%	-0,24%	-0,51%	1,76%	1,97%	-	-	-	-	-	-0,56%	12,02%
	%CDI	30%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

Fechamento De Mês (R\$ - Mil)

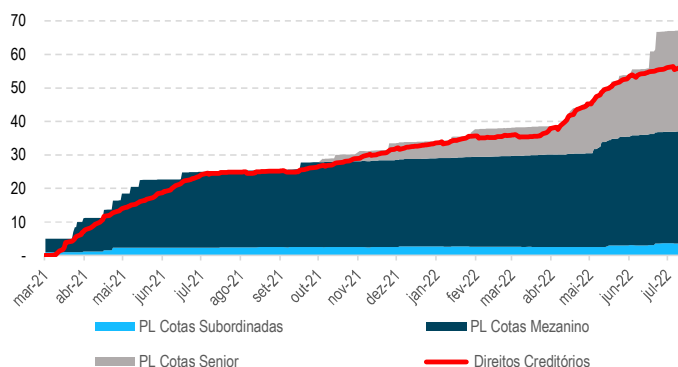
Valores da planilha em R\$ mil

	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

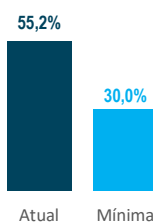


Evolução Patrimonial (R\$ milhões)

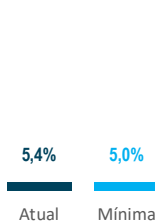


Indicadores de acompanhamento

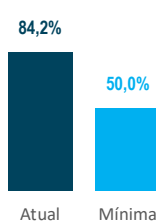
Razão de Garantia Sênior (%/PL)



Razão de Garantia Mezanino (%/PL)

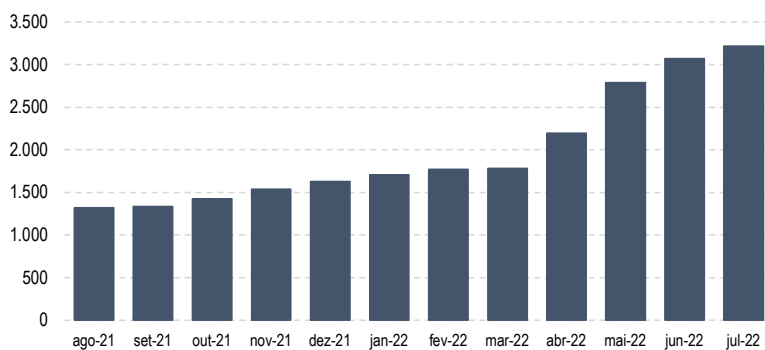


Direitos Creditórios (%/PL)

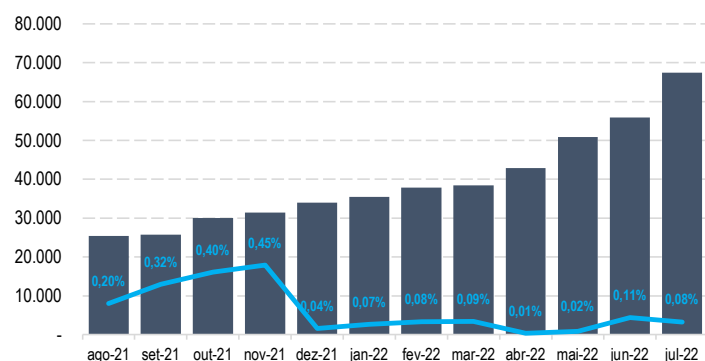


	Exigido	Atual	Situação
Atraso F30	<18%	4,79%	Enquadrado
Atraso F60	<15%	4,57%	Enquadrado
Atraso F90	<12%	0,94%	Enquadrado
Índice de Perda Líquida	<8%	0,00%	Enquadrado
Índice de Pré-Pagamento	<8%	0,21%	Enquadrado
Índice de Resolução de Cessão	<3%	0,00%	Enquadrado

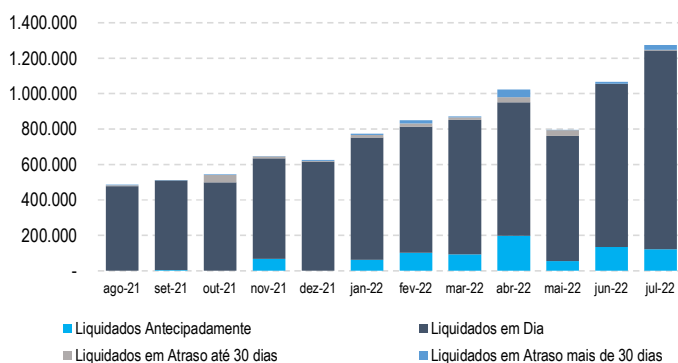
Quantidade de Devedores



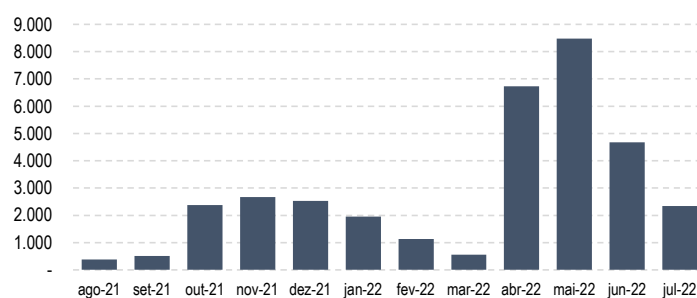
PDD e Patrimônio Líquido (R\$ - Mil)



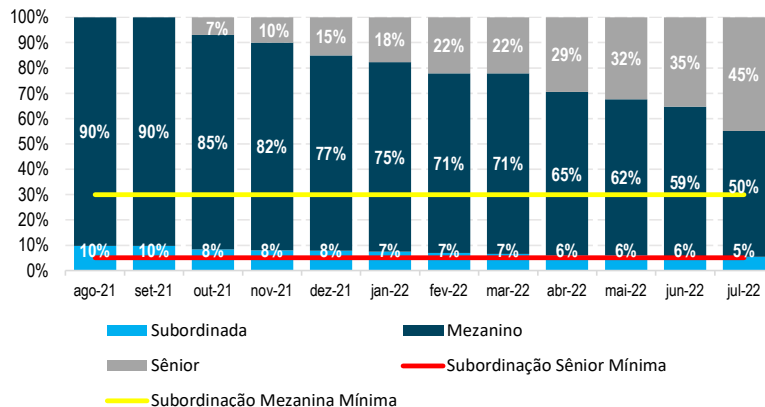
Comportamento das Liquidações dos Títulos



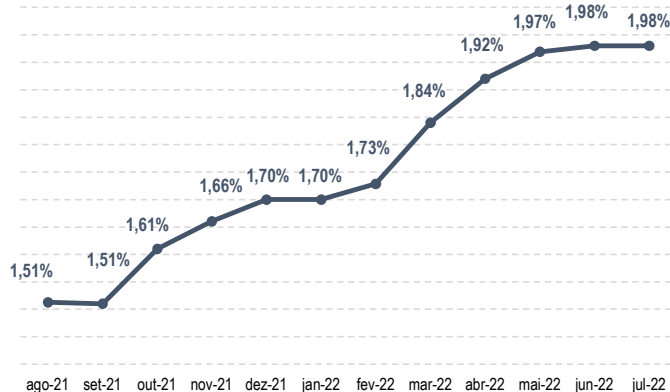
Volume Operado Mensal



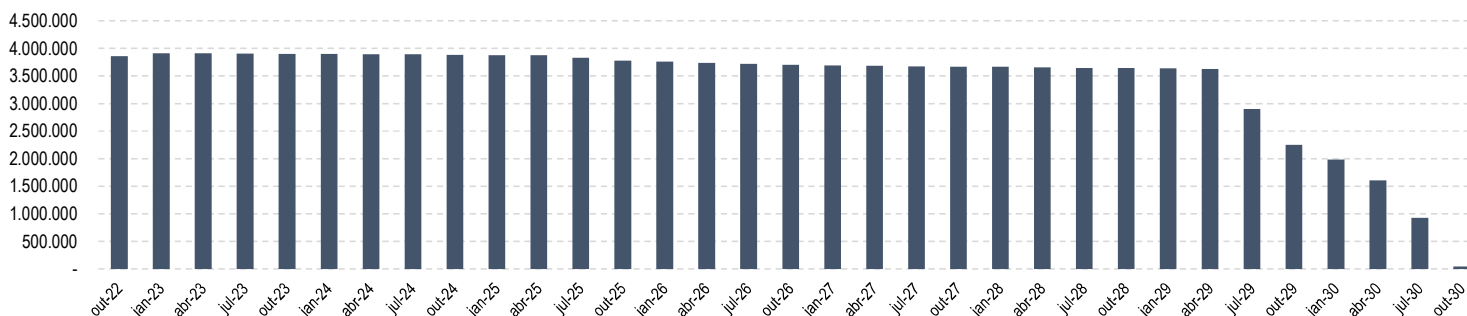
Distribuição de Passivo



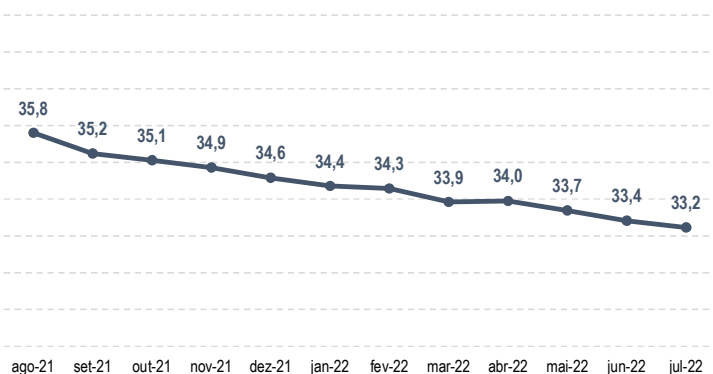
Taxa Média (a.m.)



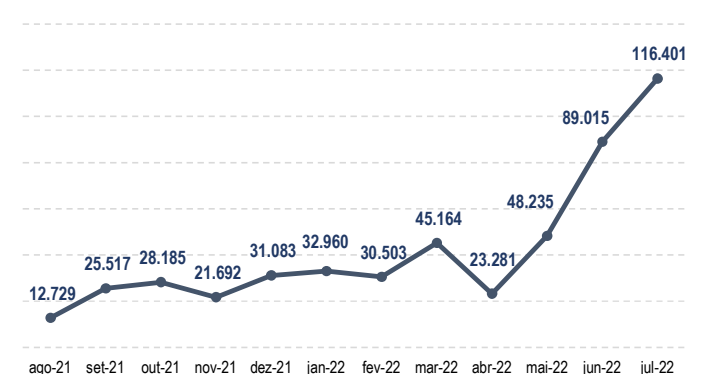
Cronograma de Vencimentos (Acumulado Trimestralmente) - R\$ mil



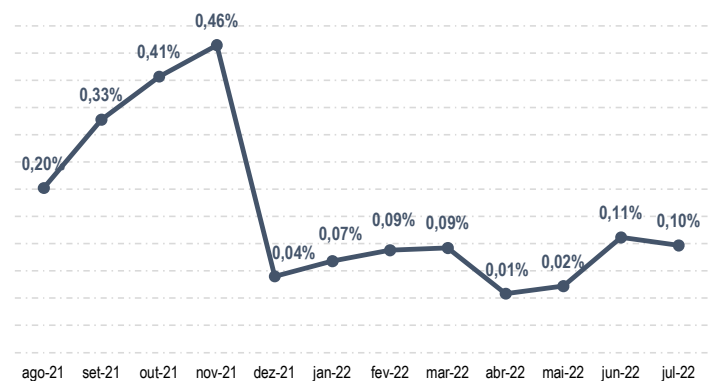
Duration Da Carteira (Meses)



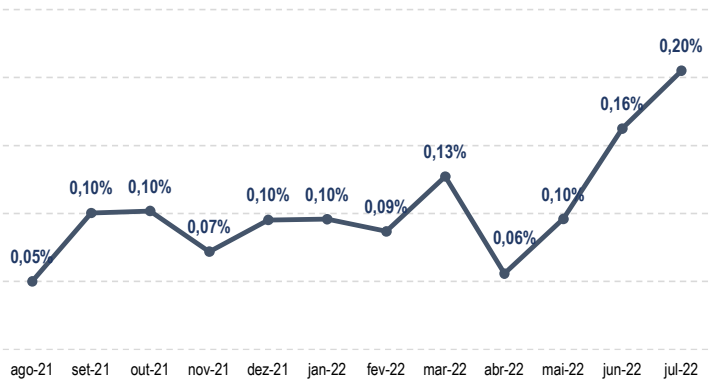
Crédito Vencido e Não Pago (R\$)



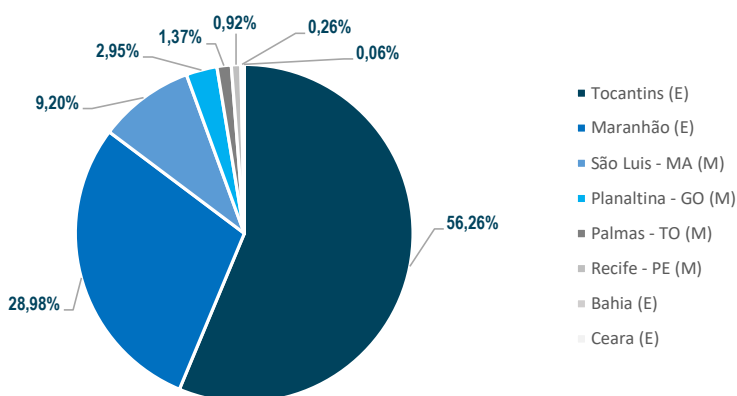
PDD/DC



Crédito Vencido e Não Pago/DC



Concentração por Ente Público Conveniado/DC



Concentração por Idade/DC

