



RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

Agosto/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

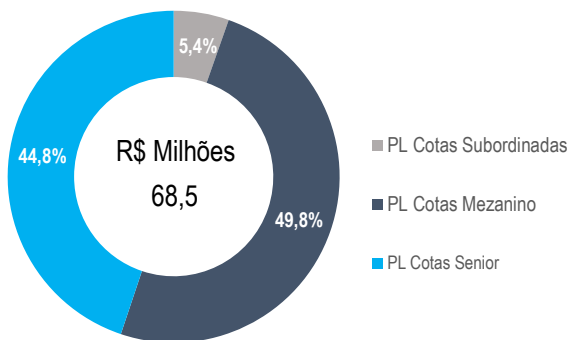
| | | jan | fev | mar | abr | mai | jun | jul | ago | set | out | nov | dez | Ano | Acum. |
|------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 2021 | Fundo | - | - | -4,36% | 0,43% | 1,34% | 2,52% | 2,74% | 3,24% | 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% | 0,80% | - | - | - | - | 0,24% | 12,92% |
| | %CDI | 30% | - | - | - | - | 173% | 191% | 69% | - | - | - | - | 3% | 107% |

Fechamento De Mês (R\$ - Mil)

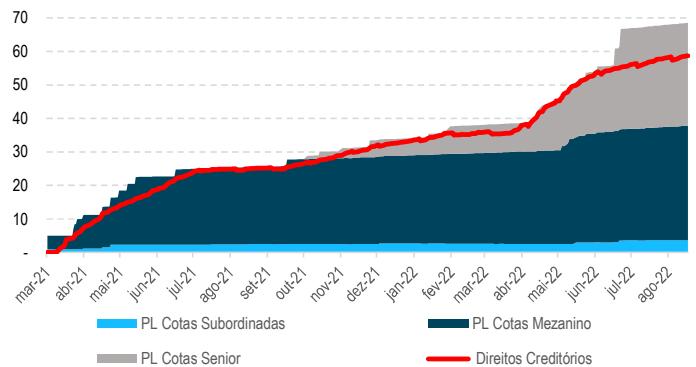
Valores da planilha em R\$ mil

| | set-21 | out-21 | nov-21 | dez-21 | jan-22 | fev-22 | mar-22 | abr-22 | mai-22 | jun-22 | jul-22 | ago-22 |
|------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Direitos Creditórios | 25.435 | 27.684 | 30.164 | 32.644 | 34.405 | 35.189 | 35.515 | 41.800 | 50.266 | 54.789 | 56.801 | 58.698 |
| Caixa (Saldo em Tesouraria) | 4 | 4 | 5 | 8 | 22 | 144 | 1 | 90 | 16 | 12 | 6 | 112 |
| Títulos Públicos | 304 | 306 | 308 | 311 | 313 | 113 | 114 | 115 | 116 | 118 | 119 | 120 |
| Cotas de Fundos (Zeragem de Caixa) | 107 | 2.203 | 1.087 | 1.064 | 843 | 2.539 | 2.890 | 995 | 535 | 1.078 | 10.704 | 9.824 |
| | set-21 | out-21 | nov-21 | dez-21 | jan-22 | fev-22 | mar-22 | abr-22 | mai-22 | jun-22 | jul-22 | ago-22 |
| Sênior | - | 2.005 | 3.033 | 5.095 | 6.263 | 8.355 | 8.482 | 12.603 | 16.443 | 19.698 | 30.251 | 30.727 |
| Mezanino | 23.197 | 25.482 | 25.798 | 26.189 | 26.561 | 26.925 | 27.368 | 27.766 | 31.366 | 33.052 | 33.556 | 34.129 |
| Subordinada | 2.509 | 2.531 | 2.527 | 2.648 | 2.653 | 2.601 | 2.556 | 2.550 | 3.038 | 3.091 | 3.662 | 3.692 |
| PL | 25.707 | 30.018 | 31.358 | 33.932 | 35.477 | 37.881 | 38.406 | 42.920 | 50.847 | 55.841 | 67.469 | 68.548 |

Patrimônio Líquido e Cotas

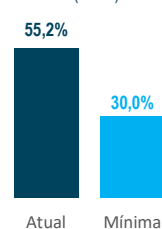


Evolução Patrimonial (R\$ milhões)

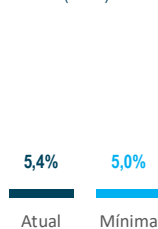


Indicadores de acompanhamento

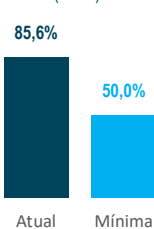
Razão de Garantia Sênior (%/PL)



Razão de Garantia Mezanino (%/PL)

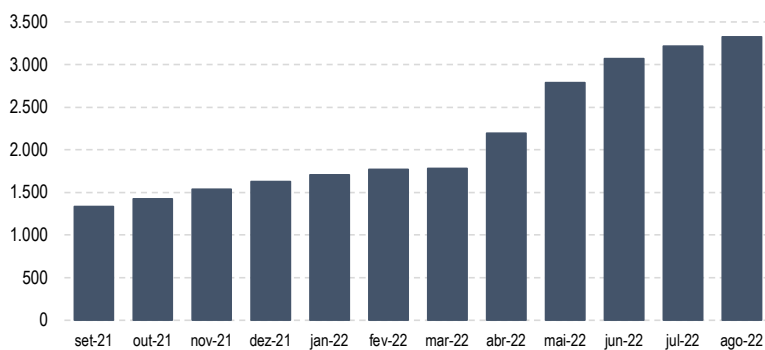


Direitos Creditórios (%/PL)

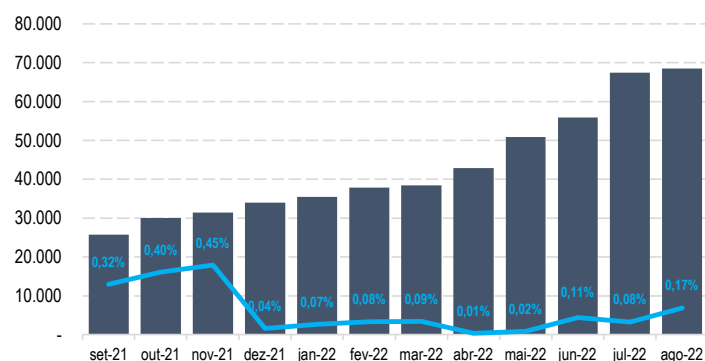


| | Exigido | Atual | Situação |
|-------------------------------|---------|-------|------------|
| Atraso F30 | <18% | 4,90% | Enquadrado |
| Atraso F60 | <15% | 4,05% | Enquadrado |
| Atraso F90 | <12% | 2,16% | Enquadrado |
| Índice de Perda Líquida | <8% | 0,00% | Enquadrado |
| Índice de Pré-Pagamento | <8% | 0,00% | Enquadrado |
| Índice de Resolução de Cessão | <3% | 0,00% | Enquadrado |

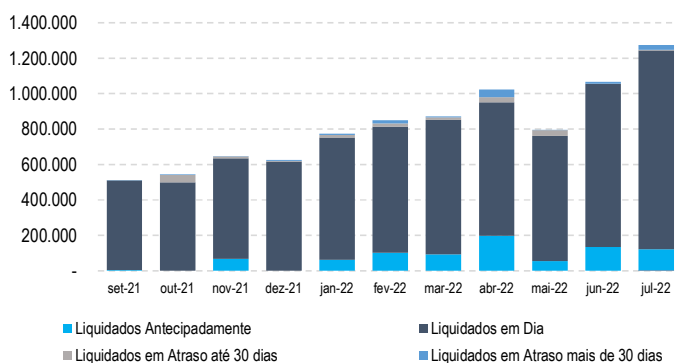
Quantidade de Devedores



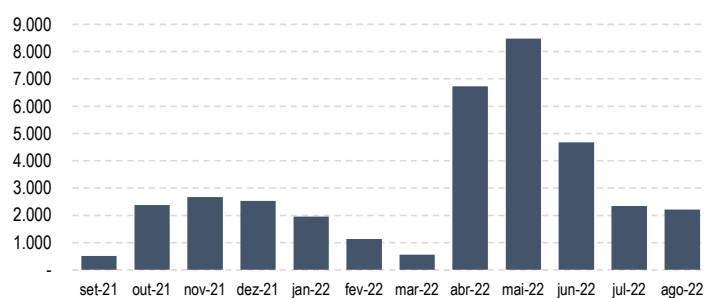
PDD e Patrimônio Líquido (R\$ - Mil)



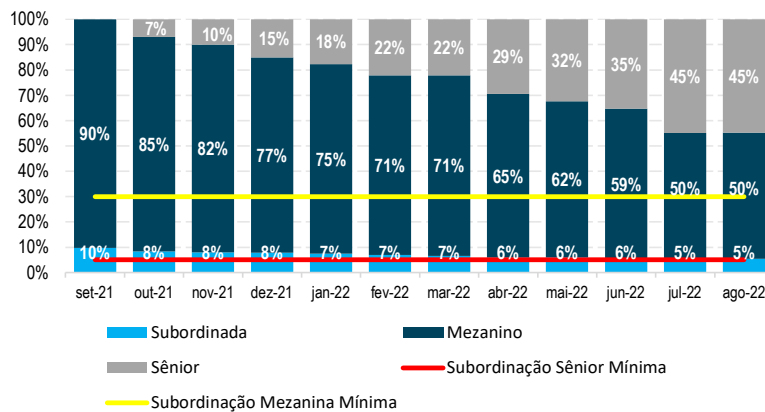
Comportamento das Liquidações dos Títulos



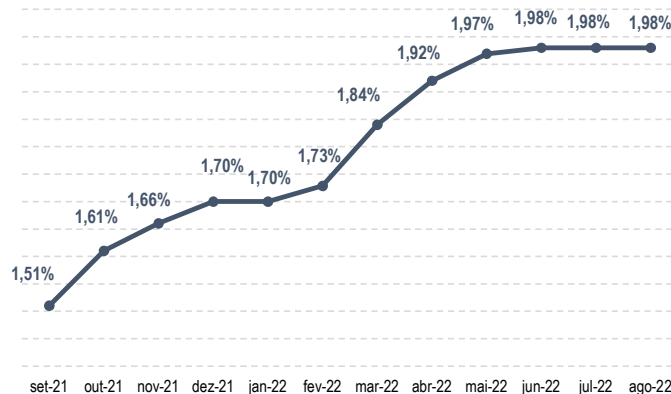
Volume Operado Mensal



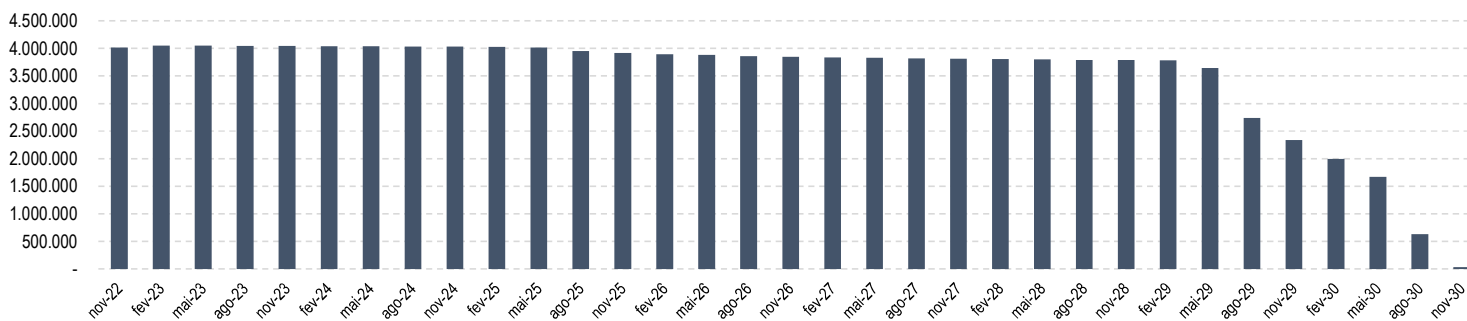
Distribuição de Passivo



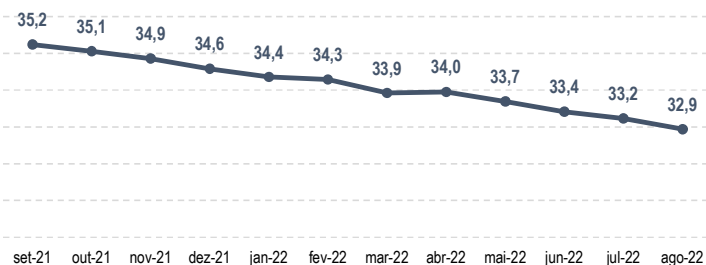
Taxa Média (a.m.)



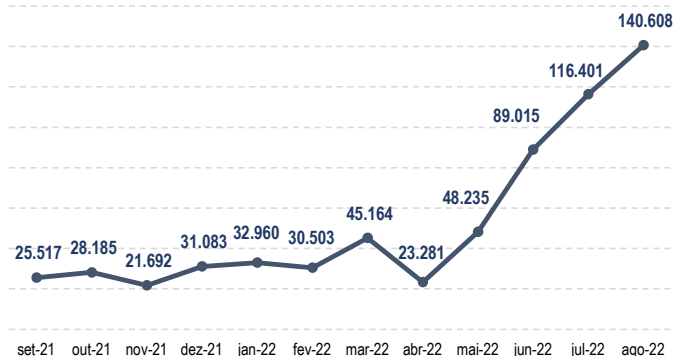
Cronograma de Vencimentos (Acumulado Trimestralmente) - R\$ mil



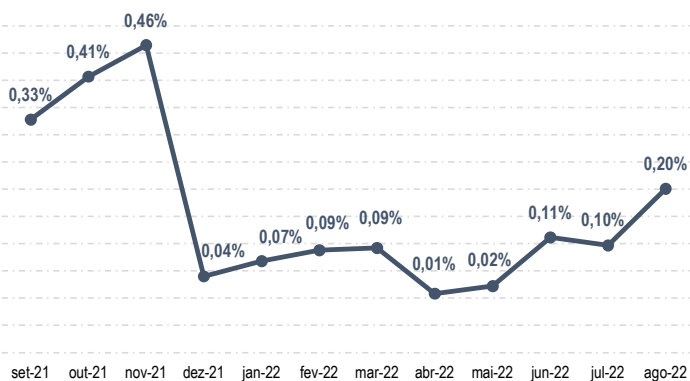
Duration Da Carteira (Meses)



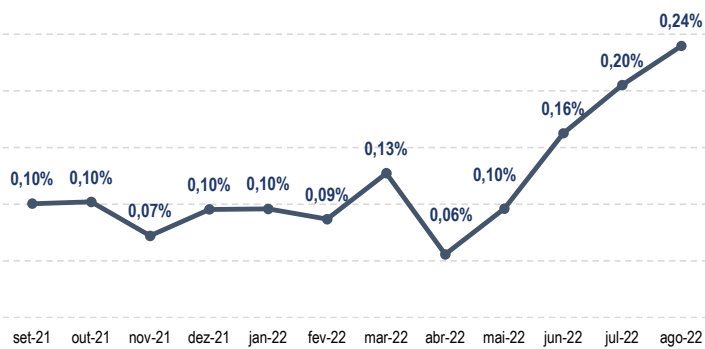
Crédito Vencido e Não Pago (R\$)



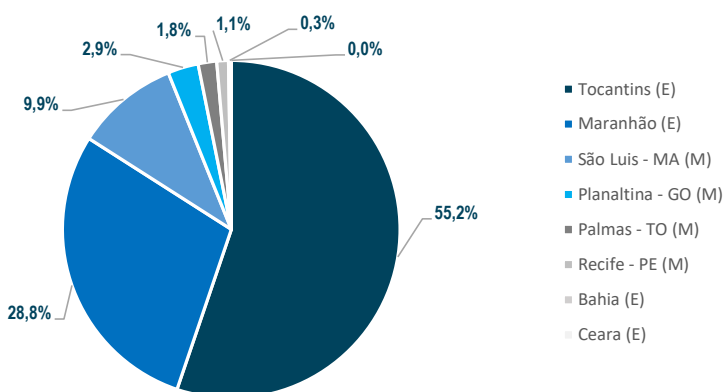
PDD/DC



Crédito Vencido e Não Pago/DC



Concentração por Ente Público Conveniado/DC



Concentração por Idade/DC

