

RELATÓRIO DE GESTÃO

OBJETIVO

É objetivo do FUNDO proporcionar aos Cotistas a valorização de suas Cotas, por meio da aplicação dos recursos do FUNDO na aquisição de Direitos Creditórios e Ativos Financeiros de acordo com os critérios de composição e diversificação estabelecidos pela legislação vigente e Regulamento.

Abril/24

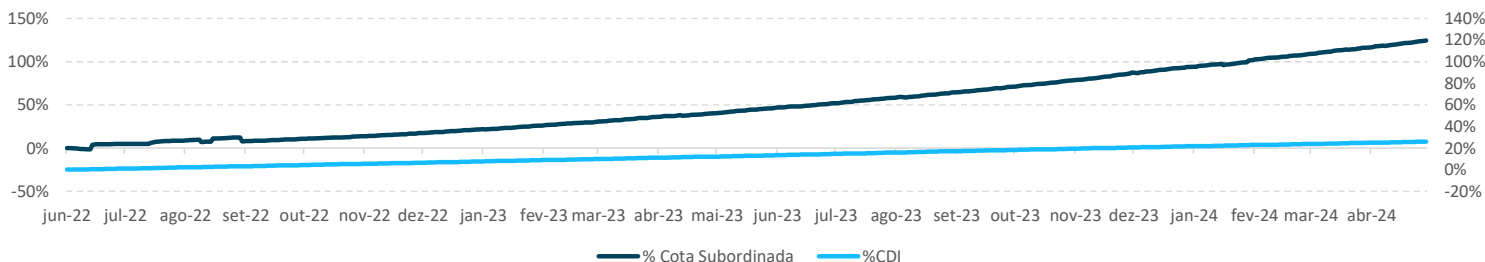
INFORMAÇÕES GERAIS

Início do Fundo 02/06/2022
 Administrador Banco Daycoval S.A.
 Gestor Valora Gestão de Investimentos Renda Fixa LTDA.
 Custodiante Banco Daycoval S.A.
 Agente de recebimento Banco Daycoval S.A.

Classe	Rentabilidade Alvo	Carência	Amortização	Vencimento
Sênior	CDI + 5,00% a.a.	18 meses	36 PMTs	dez/26
Sênior II	CDI + 4,00% a.a.	24 meses	36 PMTs	mar/29
Mezanino B	CDI + 6,50% a.a.	18 meses	36 PMTs	dez/26
Mezanino B II	CDI + 5,00% a.a.	24 meses	36 PMTs	mar/29
Mezanino A	CDI + 6,50% a.a.	12 meses	36 PMTs	mar/27

Rentabilidade Subordinada Júnior

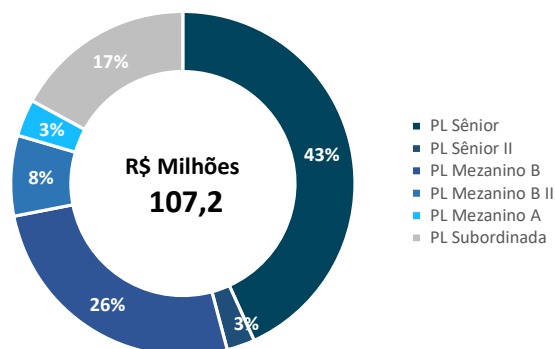
		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2022	Fundo	-	-	-	-	-	5,04%	3,44%	-0,85%	2,60%	2,66%	3,25%	3,78%	21,59%	21,59%
	%CDI	-	-	-	-	-	549%	333%	-	243%	261%	318%	336%	284%	284%
2023	Fundo	3,51%	3,39%	4,55%	2,97%	4,43%	3,72%	4,08%	3,96%	4,00%	4,35%	4,48%	3,96%	59,21%	93,58%
	%CDI	313%	370%	388%	324%	395%	347%	381%	347%	411%	436%	488%	442%	454%	433%
2024	Fundo	4,15%	3,38%	3,53%	3,92%	-	-	-	-	-	-	-	-	15,85%	124,27%
	%CDI	430%	421%	424%	442%	-	-	-	-	-	-	-	-	455%	480%



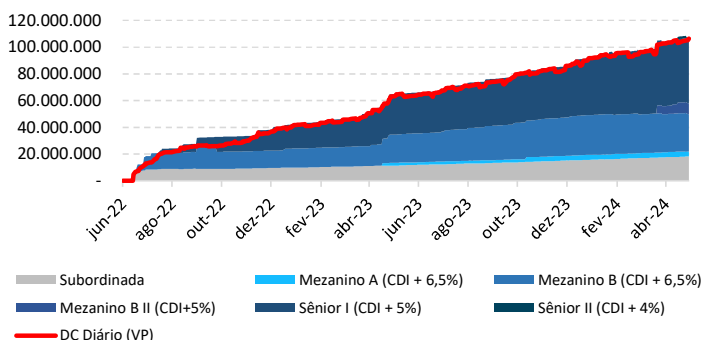
Posição Carteira e Classes

	mai/23	jun/23	jul/23	ago/23	set/23	out/23	nov/23	dez/23	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24
Direitos Creditórios	64.367	67.612	71.150	74.027	79.654	82.372	85.803	91.757	95.227	96.095	102.619	106.247
Caixa	1.629	718	453	2.123	257	1.687	-	508	573	33	878	583
Títulos Públicos	251	254	256	259	262	265	267	270	272	274	277	719
Crédito vencido e não pago	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PDD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PL Sênior	30.588	31.541	33.023	35.063	36.693	37.812	38.807	42.984	46.405	46.581	47.136	46.310
PL Sênior II	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	600	2.815
PL Mezanino B	21.532	22.378	23.751	25.676	27.208	28.225	28.627	29.787	29.401	28.927	28.452	27.988
PL Mezanino B II	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6.014	8.108
PL Mezanino A	2.044	2.077	2.110	2.147	2.179	3.523	3.573	3.624	3.679	3.726	3.776	3.724
PL Subordinada	11.890	12.332	12.836	13.344	13.878	14.482	15.131	15.731	16.384	16.938	17.536	18.224
Patrimônio Líquido	66.054	68.329	71.720	76.229	79.958	84.042	86.138	92.125	95.868	96.171	103.513	107.169

Distribuição Patrimônio Líquido

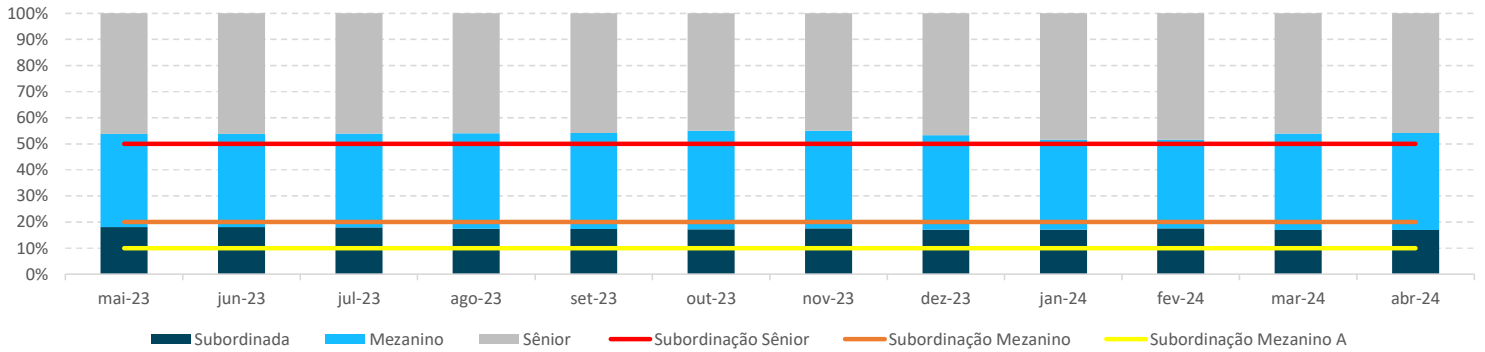


Evolução Patrimonial



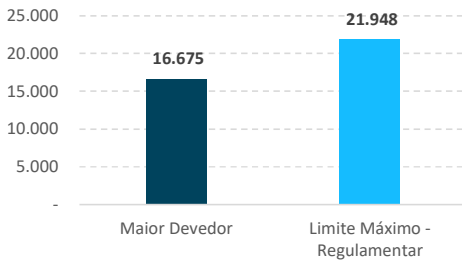


Distribuição Passivo

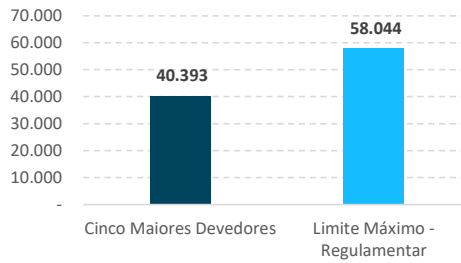


Índices de Acompanhamento

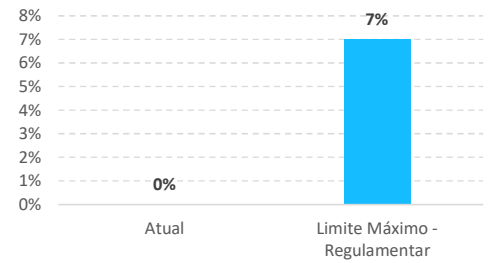
Maior Concentração



Cinco maiores Concentrações

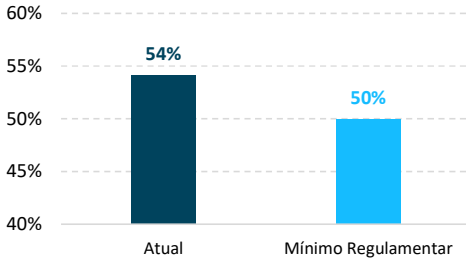


Índice de Atraso

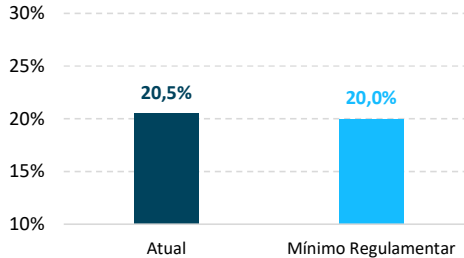


Índices de Subordinação

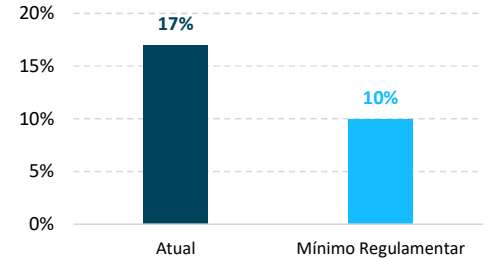
Subordinação Sênior



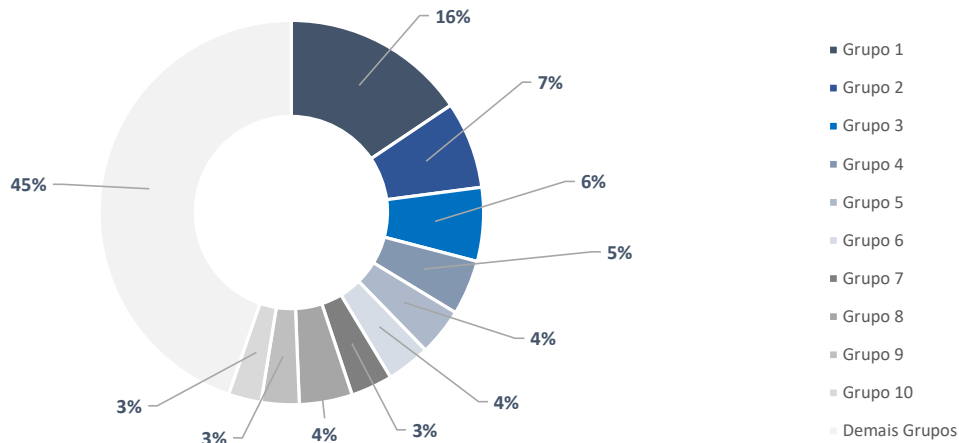
Subordinação Mezanino



Subordinação Mezanino A

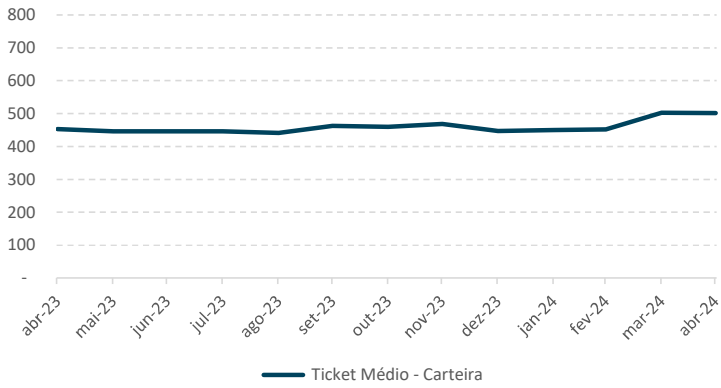


Concentração - Grupo Econômico

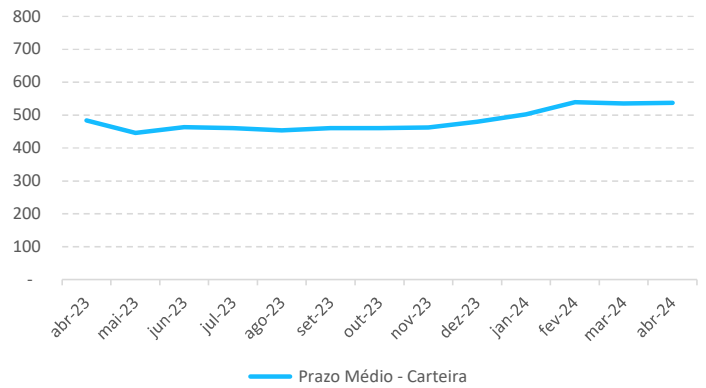




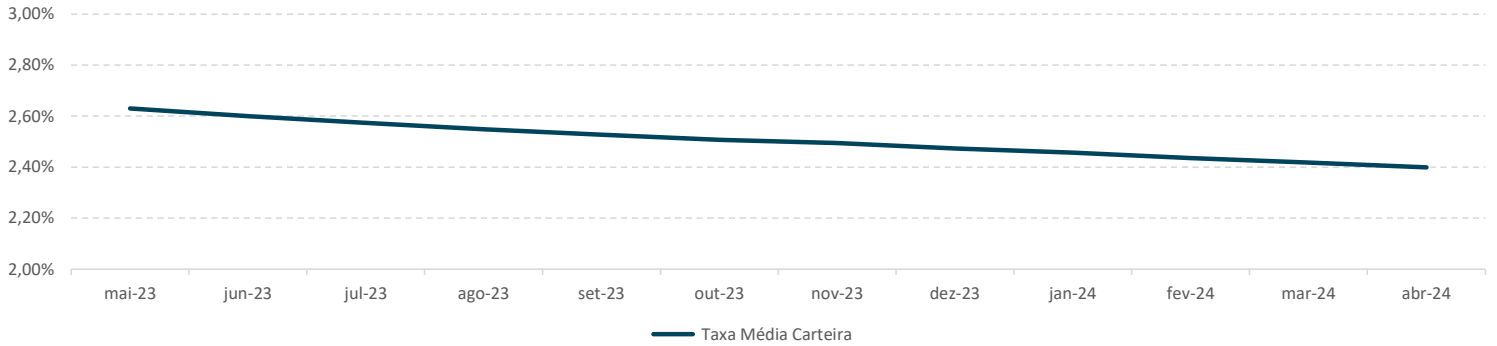
Ticket Médio - R\$ mil



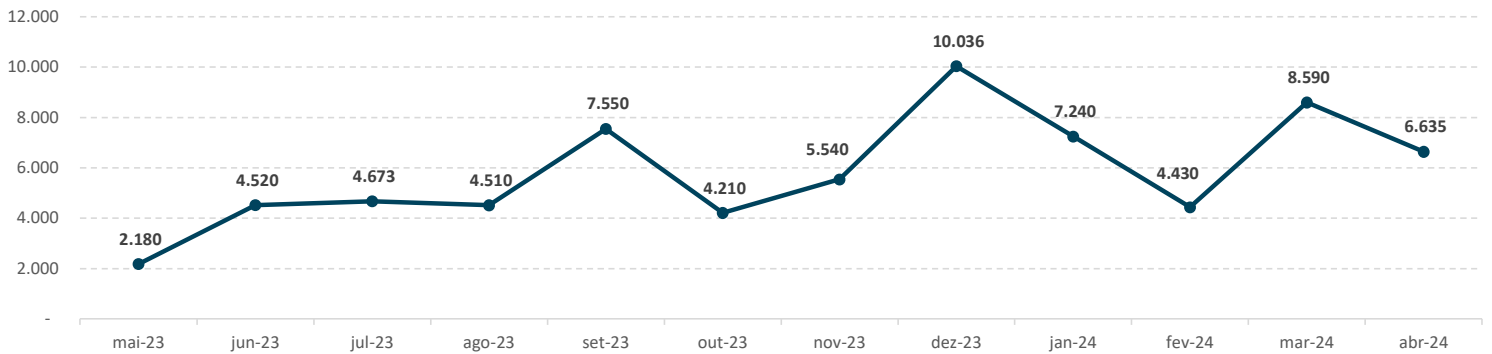
Prazo Médio - Dias



Taxa Média - Carteira



Volume Operado - R\$ mil



Cronograma de Vencimento - R\$ mil

