

## RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

Junho/2024

## OBJETIVO

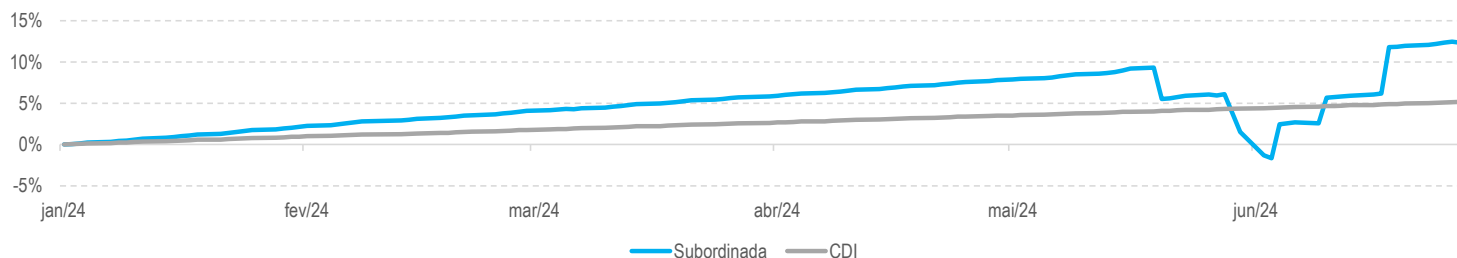
O Fundo tem como objetivo proporcionar aos Cotistas a valorização das suas Cotas por meio da aplicação de recursos, preponderantemente, nos Direitos Creditórios, observada a Política de Investimento do Fundo.

## INFORMAÇÕES GERAIS

|                           |                                                |
|---------------------------|------------------------------------------------|
| Início do Fundo           | 02/01/2024                                     |
| Administrador             | Banco Daycoval S.A.                            |
| Gestor                    | Valora Gestão de Investimentos Renda Fixa LTDA |
| Custodiante               | Banco Daycoval S.A.                            |
| Rentabilidade Cota Sênior | CDI+5,0% a.a.                                  |
| Prazo de Duração Sênior   | 48 meses                                       |
| Prazo de Carência Sênior  | 12 meses de principal                          |
| Vencimento Sênior         | 12/2028                                        |

## Rentabilidade Cota Subordinada Júnior

|      |       | jan   | fev   | mar   | abr   | mai    | jun    | jul | ago | set | out | nov | dez | Ano    | Acum.  |
|------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|--------|--------|
| 2024 | Fundo | 2,05% | 1,89% | 1,68% | 1,95% | -5,74% | 10,68% | -   | -   | -   | -   | -   | -   | 12,37% | 12,37% |
|      | %CDI  | 222%  | 236%  | 202%  | 220%  | -      | 1354%  | -   | -   | -   | -   | -   | -   | 239%   | 239%   |



## Posição Carteira e Classes

|                      | mar/24 | abr/24 | mai/24 | jun/24 | jul/24 | ago/24 | set/24 | out/24 | nov/24 | dez/24 | jan/25 | fev/25 |
|----------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Direitos Creditórios | 65.801 | 75.818 | 84.100 | 91.029 | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Caixa                | 15.117 | 15.636 | 7.803  | 1.081  | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Títulos Públicos     | 306    | 309    | 311    | 314    | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |

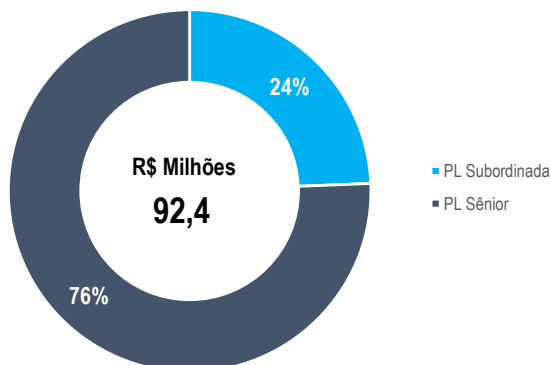
  

|                            | mar/24 | abr/24 | mai/24 | jun/24 | jul/24 | ago/24 | set/24 | out/24 | nov/24 | dez/24 | jan/25 | fev/25 |
|----------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Crédito Vencido e não pago | -      | 361    | 974    | 111    | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| PDD                        | 11     | 60     | 1.830  | 99     | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |

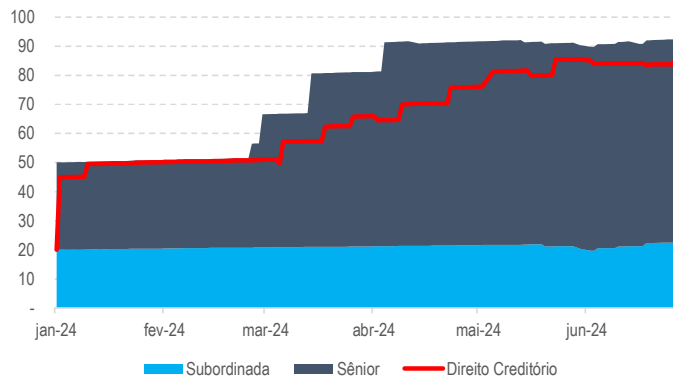
  

|                    | mar/24 | abr/24 | mai/24 | jun/24 | jul/24 | ago/24 | set/24 | out/24 | nov/24 | dez/24 | jan/25 | fev/25 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Sênior             | 59.955 | 70.004 | 69.997 | 69.915 | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Mezanino           | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Subordinada        | 21.161 | 21.573 | 20.152 | 22.491 | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Patrimônio Líquido | 81.116 | 91.577 | 90.149 | 92.406 | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |

## Distribuição Patrimônio Líquido

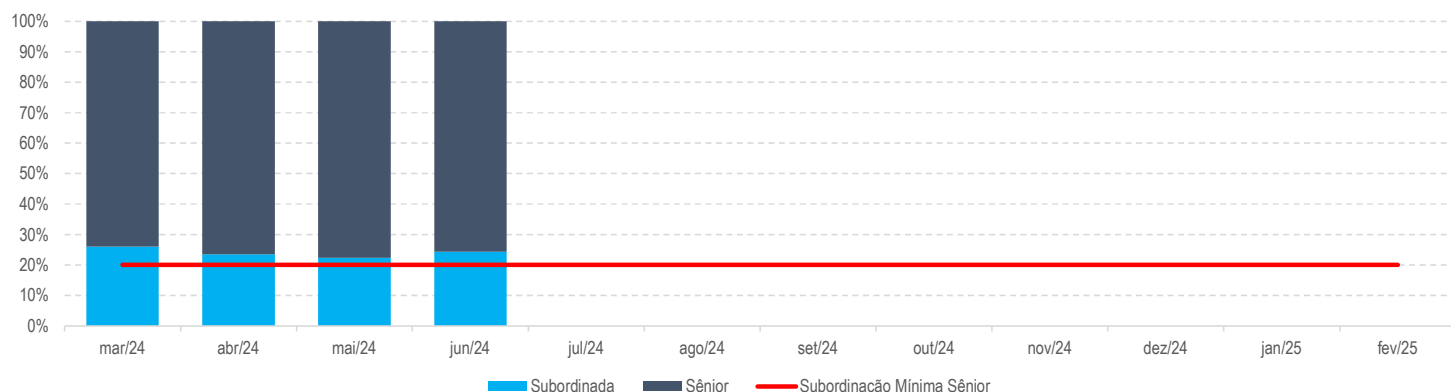


## Evolução Patrimonial - R\$ milhões



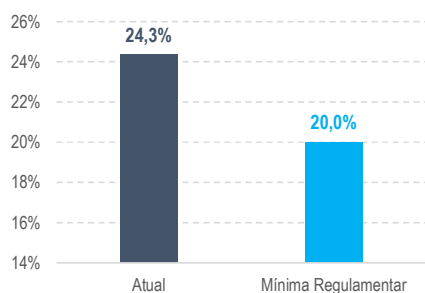


## Passivo e Índice de Subordinação

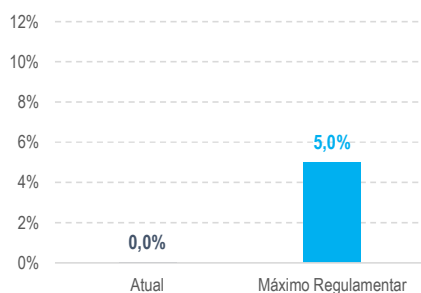


## Índices de Acompanhamento

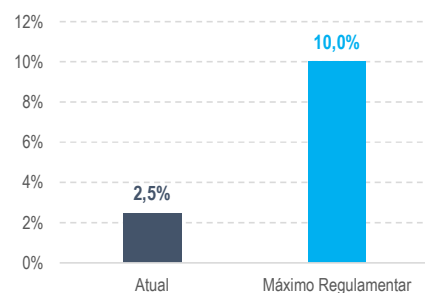
Subordinação Sênior



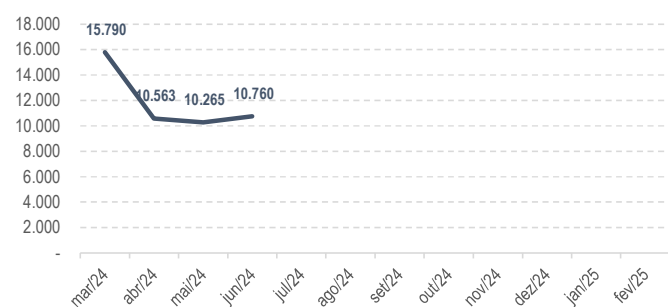
Índice de Ataso



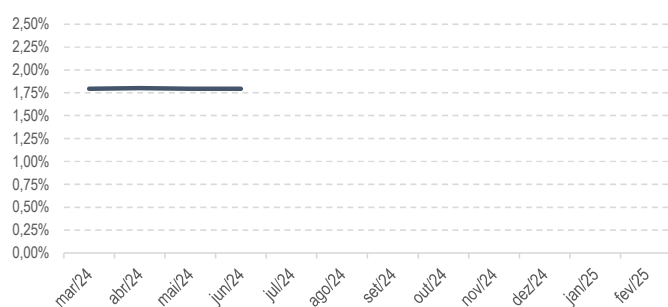
Índice de Recompra



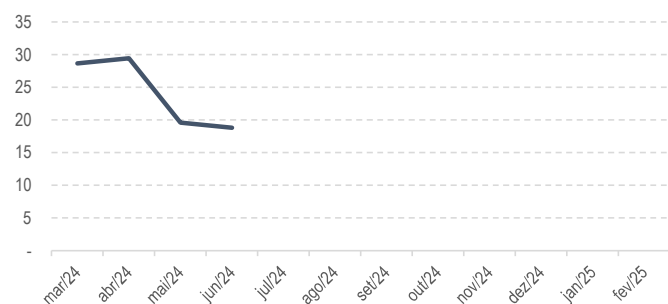
## Volume Operado - R\$ mil



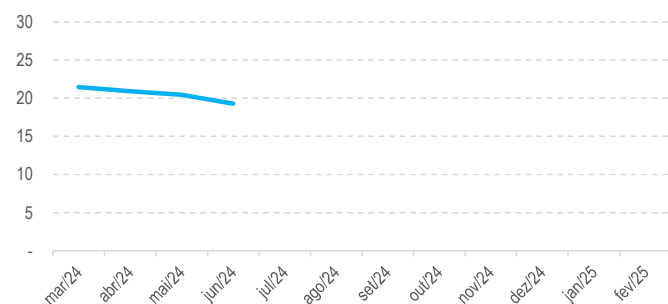
## Taxa média - Carteira



## Ticket médio mês - R\$ mil



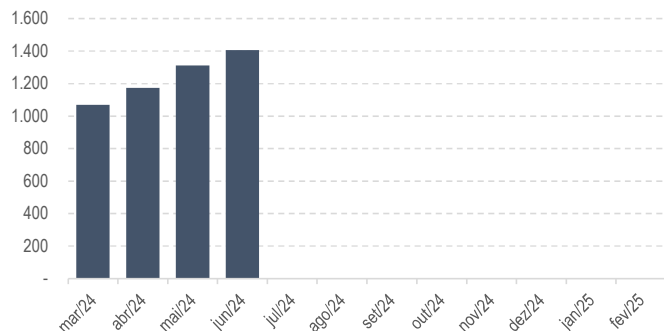
## Prazo médio - Meses



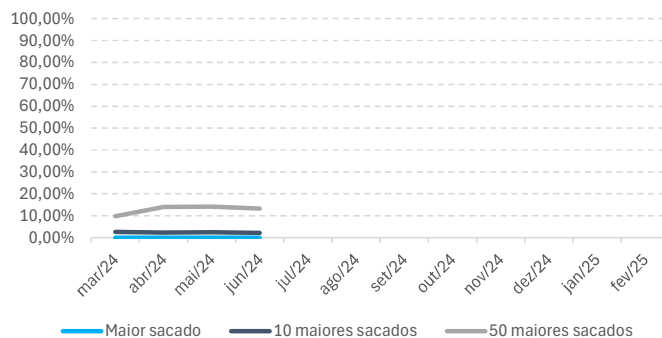
\* Não houve operação em fevereiro/2024.



## Quantidade de sacados



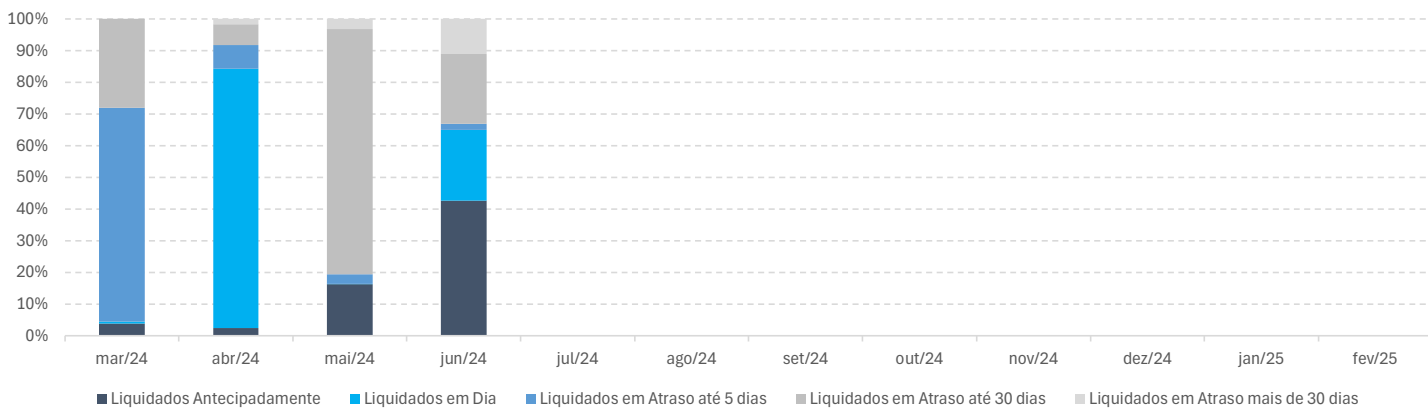
## Concentração dos sacados



## Crédito vencido e não pago R\$ mil - Histórico acumulado



## Comportamento das Liquidações dos Títulos (R\$ mil)



## Cronograma de Vencimento - R\$ mil

