

RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

Julho/2024

OBJETIVO

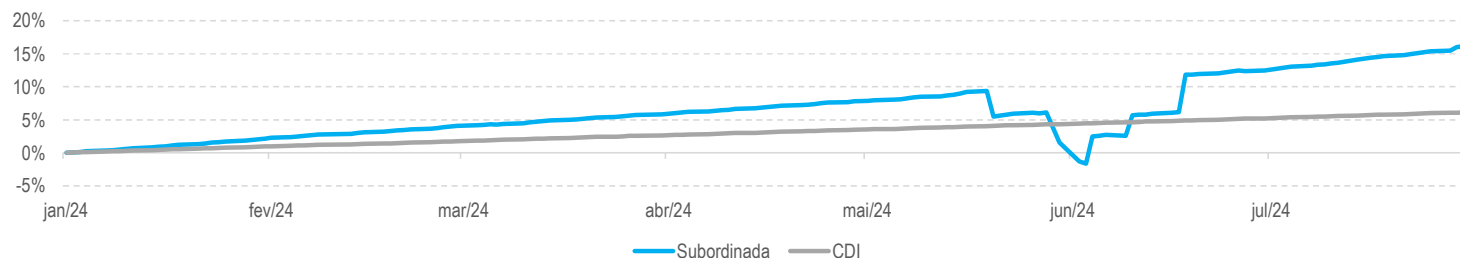
O Fundo tem como objetivo proporcionar aos Cotistas a valorização das suas Cotas por meio da aplicação de recursos, preponderantemente, nos Direitos Creditórios, observada a Política de Investimento do Fundo.

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%	3,37%	-	-	-	-	-	16,16%	16,16%
	%CDI	222%	236%	202%	220%	-	1354%	372%	-	-	-	-	-	264%	264%



Valores das tabelas em R\$ mil

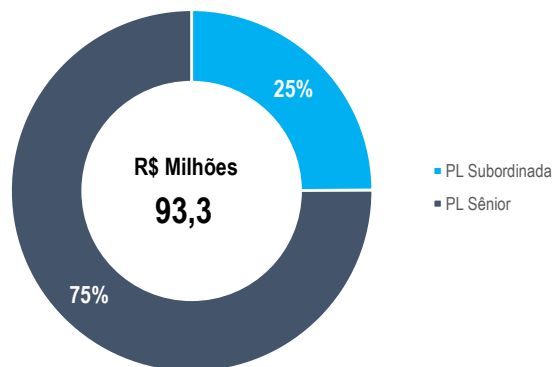
Posição Carteira e Classes

	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	set/24	out/24	nov/24	dez/24
Direitos Creditórios	50.079	50.862	65.801	75.818	84.100	91.029	89.915	-	-	-	-	-
Caixa	502	5.483	15.117	15.636	7.803	1.081	3.068	-	-	-	-	-
Títulos Públicos	301	303	306	309	311	314	316	-	-	-	-	-

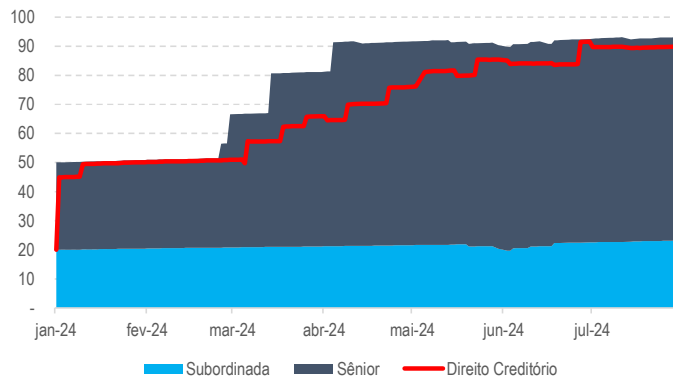
	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	set/24	out/24	nov/24	dez/24
Crédito Vencido e não pago	-	-	-	361	974	111	48	-	-	-	-	-
PDD	-	-	11	60	1.830	99	27	-	-	-	-	-

	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	set/24	out/24	nov/24	dez/24
Sênior	30.400	35.763	59.955	70.004	69.997	69.915	70.038	-	-	-	-	-
Mezanino	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Subordinada	20.424	20.810	21.161	21.573	20.152	22.491	23.249	-	-	-	-	-
Patrimônio Líquido	50.824	56.573	81.116	91.577	90.149	92.406	93.287	-	-	-	-	-

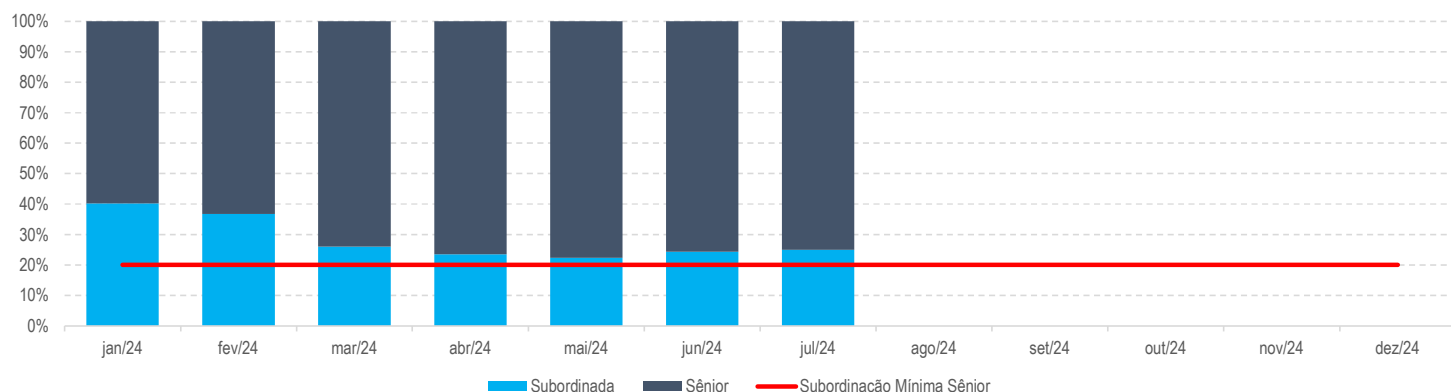
Distribuição Patrimônio Líquido



Evolução Patrimonial - R\$ milhões

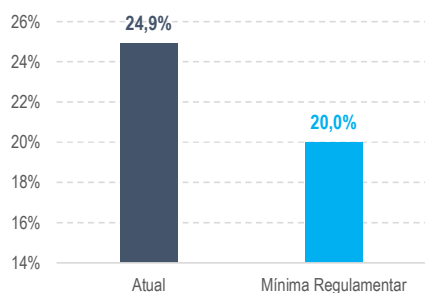


Passivo e Índice de Subordinação

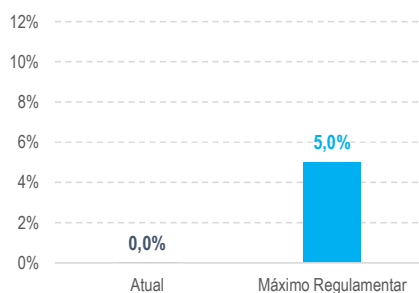


Índices de Acompanhamento

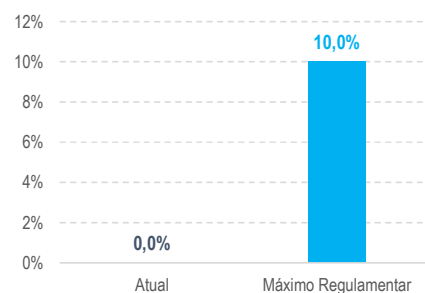
Subordinação Sênior



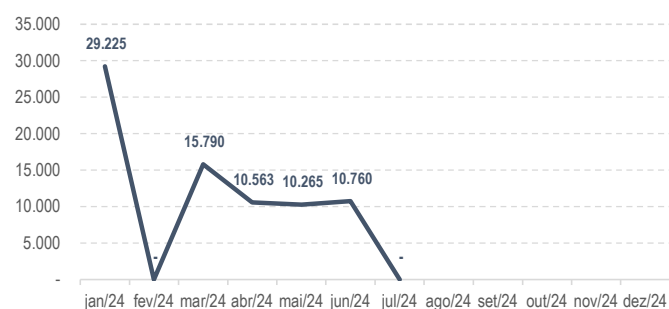
Índice de Ataso



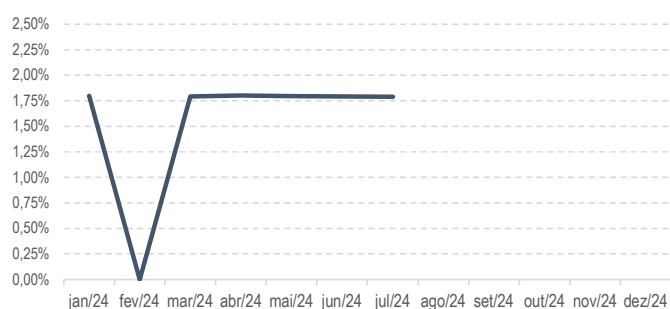
Índice de Recompra



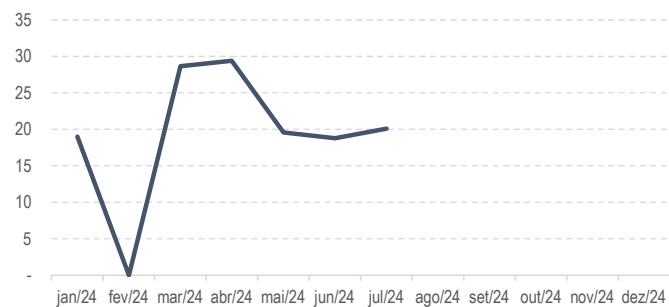
Volume Operado - R\$ mil



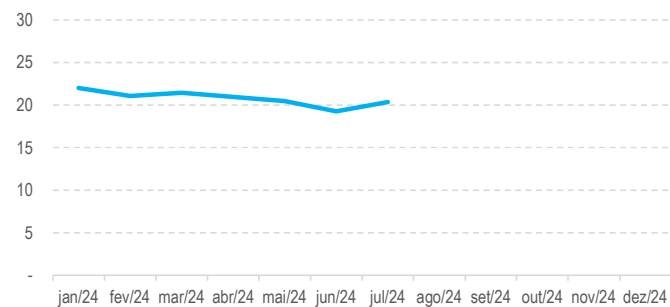
Taxa média - Carteira



Ticket médio mês - R\$ mil



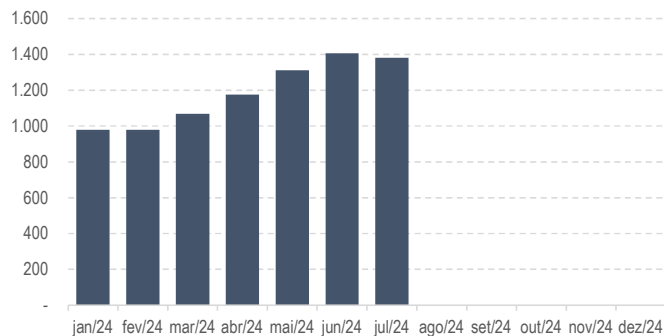
Prazo médio - Meses



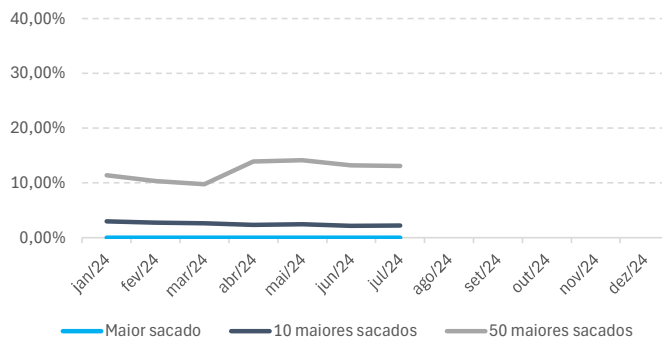
* Não houve operação em fevereiro de 2024.



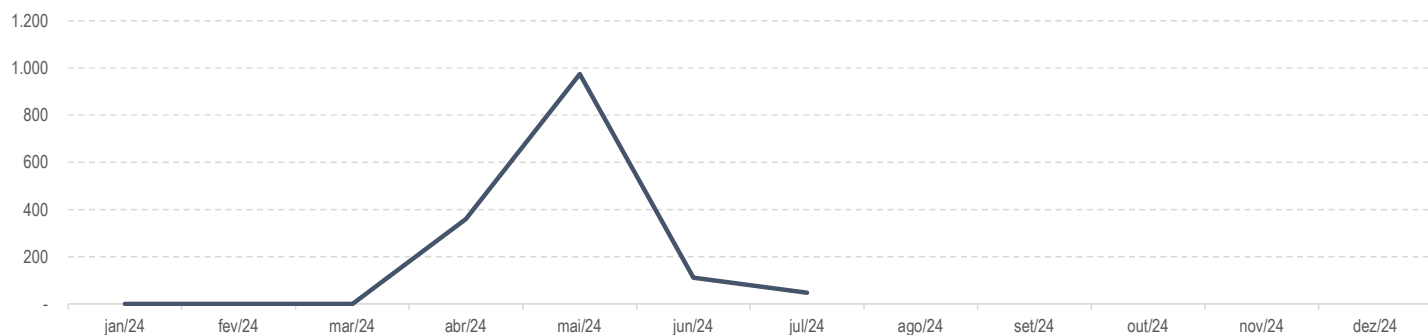
Quantidade de sacados



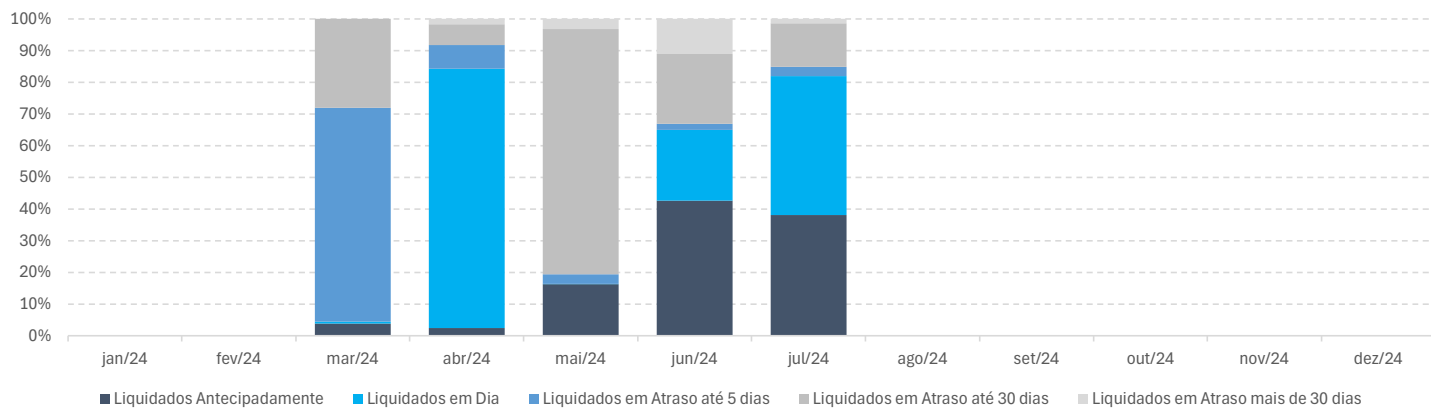
Concentração dos sacados



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



Comportamento das Liquidações dos Títulos (R\$ mil)



Cronograma de Vencimento - R\$ mil

