



RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

OBJETIVO

Proporcionar aos Cotistas a valorização das suas Cotas por meio da aplicação de recursos, preponderantemente, nos Direitos Creditórios, observada a política de investimento da Classe.

Junho/24

INFORMAÇÕES GERAIS

Início do Fundo	01/03/2024
Administrador	Banco Daycival S.A.
Gestor	Valora Gestão de Investimentos Renda Fixa LTDA
Custodiante	Banco Daycival S.A.
Agência de Rating	Austin Rating

Classe	Rating	Rentabilidade Alvo	Carência	Juros/Remuneração	Amortização	Vencimento
Sênior	'brAA(sf)'	CDI + 3,50% a.a.	36 meses de principal	Pagamento mensal a partir de abr/24	36 PMTS a partir de mar/27	fev/30
Mezanino	-	CDI + 4,75% a.a.	36 meses de principal	Pagamento mensal a partir de abr/24	36 PMTS a partir de mar/27	fev/30

Rentabilidade Cota Subordinada Júnior

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2024	Fundo	-	-	-0,98%	-2,03%	4,41%	0,83%	-	-	-	-	-	-	2,13%	2,13%
	%CDI	-	-	-	-	530%	105%	-	-	-	-	-	-	64%	64%

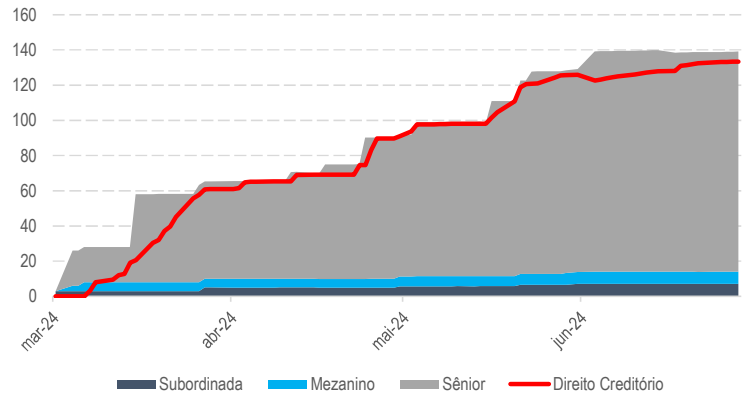
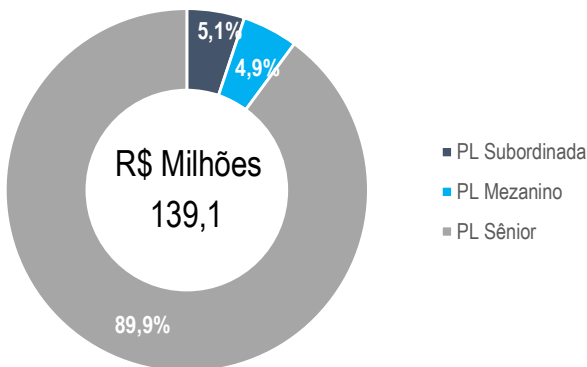
Fechamento de Mês (R\$ - Mil)

	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	60.826	90.891	125.767	133.356	-	-	-	-	-	-	-	-
Caixa (Fundos de zeragem)	4.595	947	3.226	5.740	-	-	-	-	-	-	-	-
Títulos Públicos	-	-	148	149	-	-	-	-	-	-	-	-

	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	55.355	80.412	115.117	125.045	-	-	-	-	-	-	-	-
Mezanino	5.052	5.632	6.879	6.875	-	-	-	-	-	-	-	-
Subordinada	4.973	5.672	7.083	7.142	-	-	-	-	-	-	-	-
PL	65.379	91.716	129.079	139.062	-	-	-	-	-	-	-	-

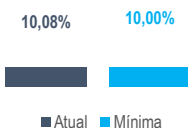
Patrimônio Líquido e Cotas

Evolução Patrimonial (R\$ milhões)

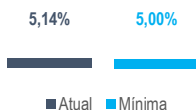


Fechamento de Mês (R\$ - Mil)

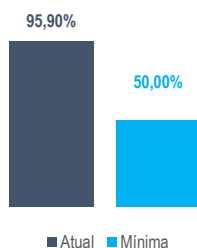
Razão de Garantia Sênior (%PL)



Razão de Garantia Mezanino (%PL)



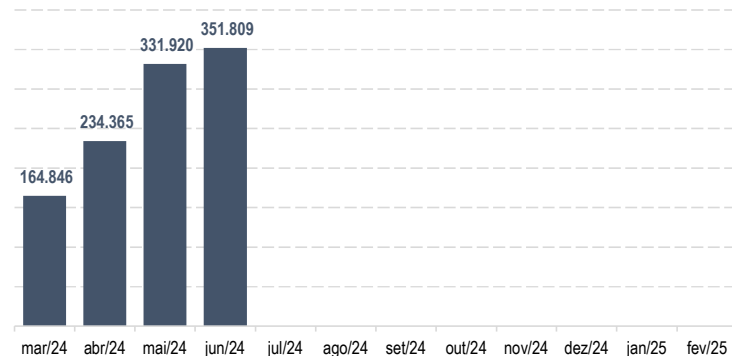
Direito Creditórios líquido de PDD (%PL)



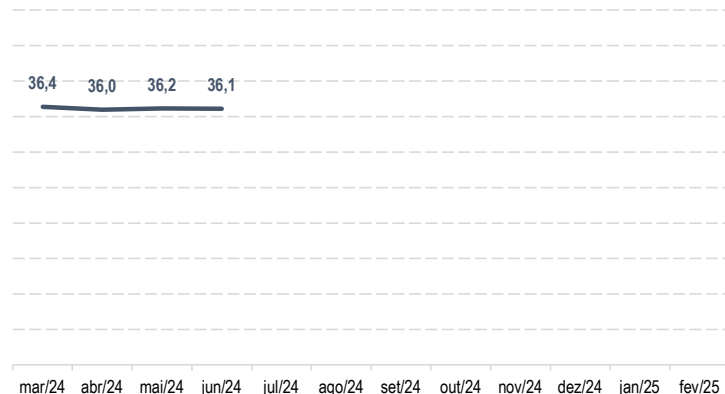
Índice de Cobertura Sênior	>=1	1,004 Enquadrado
Índice de Cobertura Mezanino	>=1	1,002 Enquadrado
Índice de Resolução de Cessão	<=1%	0,00% Enquadrado
Índice de Pré-Pagamento	<=3%	0,01% Enquadrado
Índice de Atraso	<=10%	0,00% Enquadrado
Índice de Arrecadação	>=93%	100,00% Enquadrado



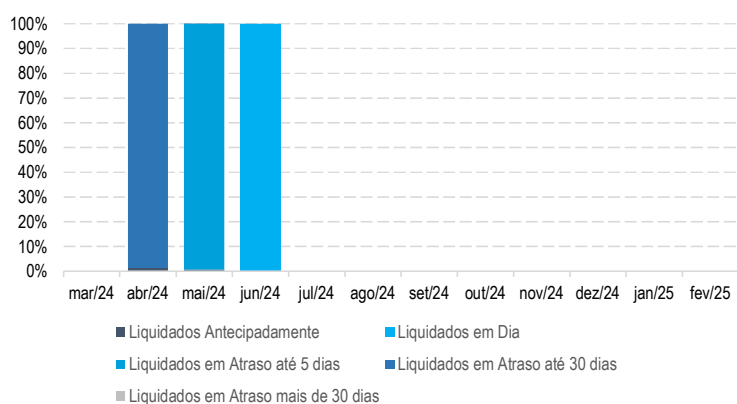
Quantidade de Devedores



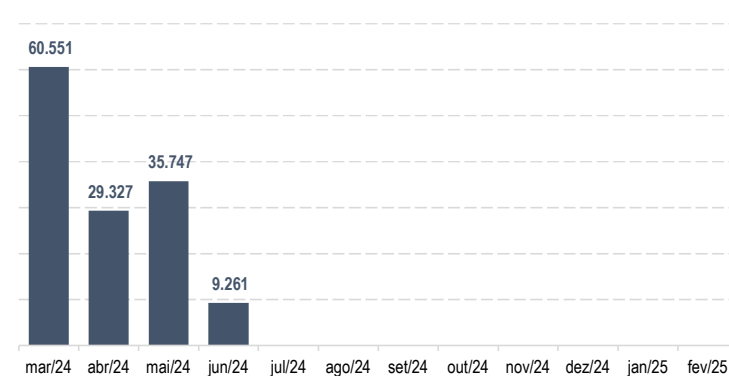
Prazo Médio da Carteira (Meses)



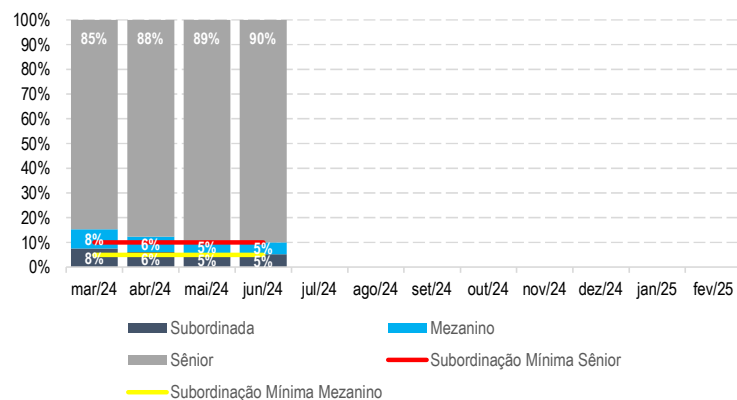
Comportamento das Liquidações dos Títulos (R\$ mil)



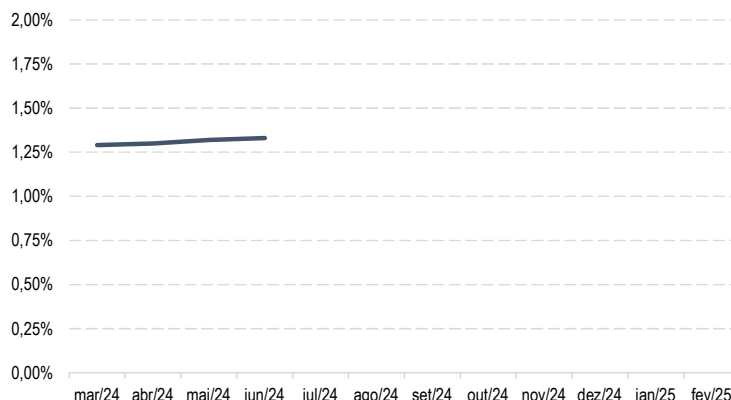
Volume Operado Mensal (R\$ mil)



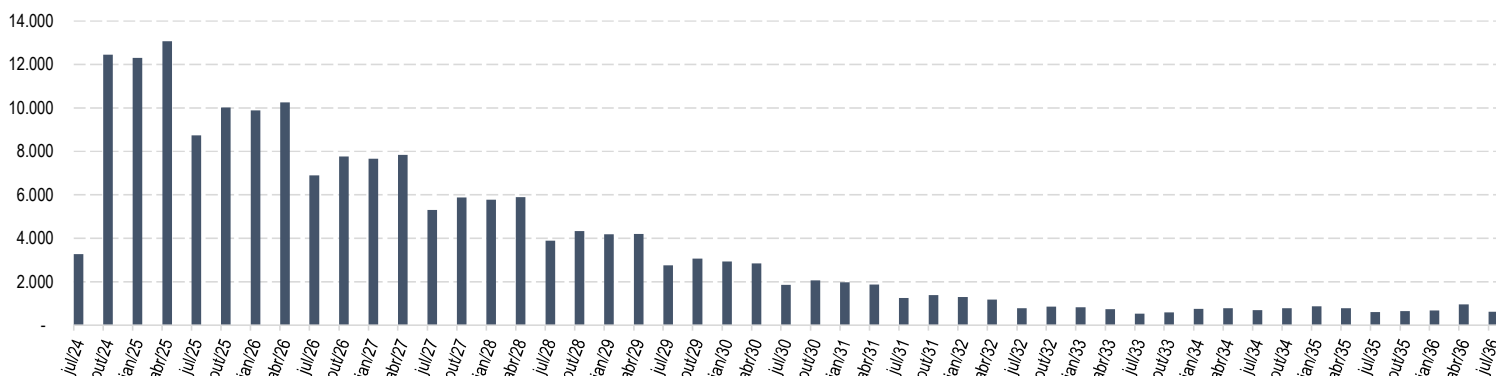
Distribuição de Passivo



Taxa Média Aquisição (a.m.)*

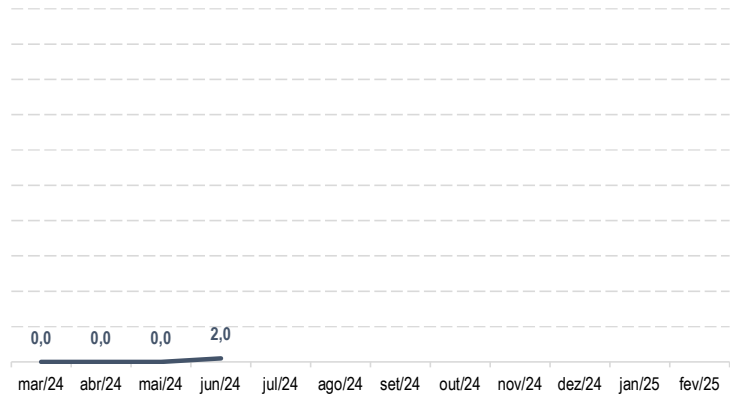


Cronograma de Vencimentos (Acumulado Trimestralmente) - R\$ mil

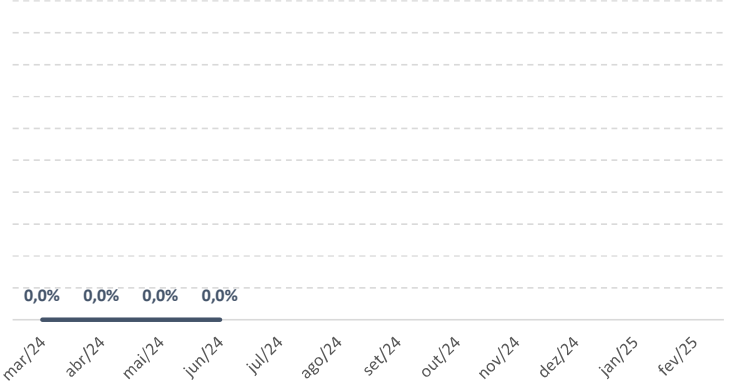




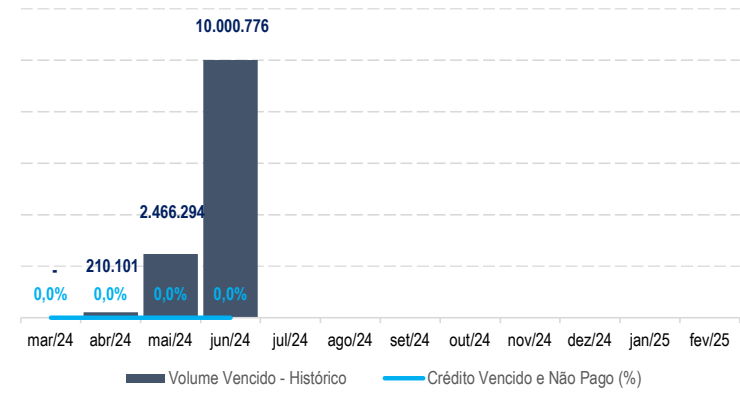
Crédito Vencido e Não Pago Acumulado (R\$ mil)



PDD x Direito Creditório



Crédito Vencido e Não Pago x Vencimento Histórico Acumulado (R\$ -



PDD x Patrimônio Líquido

