

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 de Ativos Financeiros de acordo com os critérios de composição e diversificação estabelecidos nos Anexos deste Regulamento e demais disposições legais e regulamentares que forem aplicáveis ao FUNDO.

Outubro/24

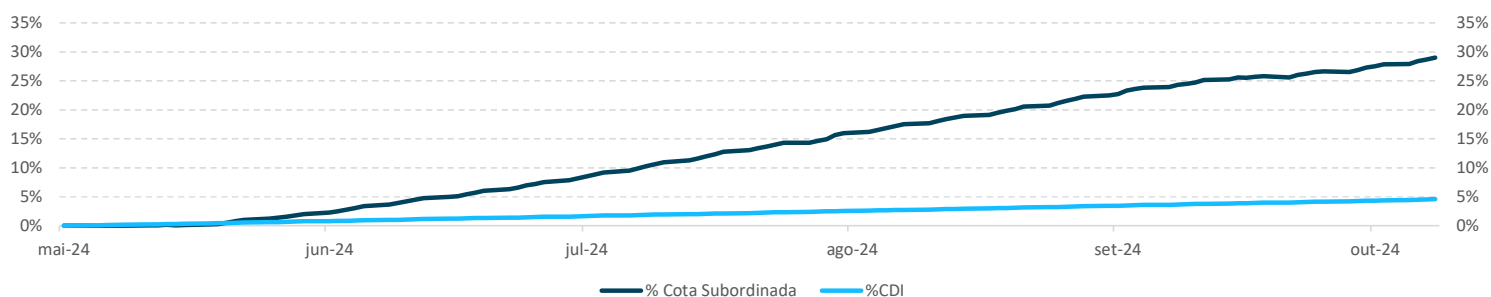
INFORMAÇÕES GERAIS

Início do Fundo 24/05/2024  
 Administrador Banco Daycoval S.A.  
 Gestor Valora Gestão de Investimentos Renda Fixa LTDA.  
 Custodiante Banco Daycoval S.A.

| Classe     | Rentabilidade Alvo | Carência | Amortização | Vencimento |
|------------|--------------------|----------|-------------|------------|
| Sênior     | CDI + 6,00% a.a.   | 12 meses | 12 PMTs     | 24 meses   |
| Mezanino B | CDI + 8,00% a.a.   | 12 meses | 12 PMTs     | 24 meses   |

Rentabilidade Subordinada Júnior

|       | jan | fev | mar | abr | mai   | jun   | jul   | ago   | set   | out   | nov | dez | Ano    | Acum.  |
|-------|-----|-----|-----|-----|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----|-----|--------|--------|
| 2024  |     |     |     |     |       |       |       |       |       |       |     |     |        |        |
| Fundo | -   | -   | -   | -   | 0,02% | 3,32% | 6,70% | 6,56% | 5,49% | 4,06% | -   | -   | 28,98% | 28,98% |
| %CDI  | -   | -   | -   | -   | 16%   | 421%  | 739%  | 756%  | 658%  | 437%  | -   | -   | 635%   | 635%   |

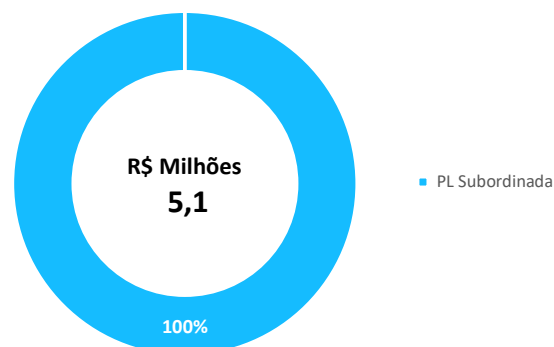


Valores das tabelas em R\$ mil

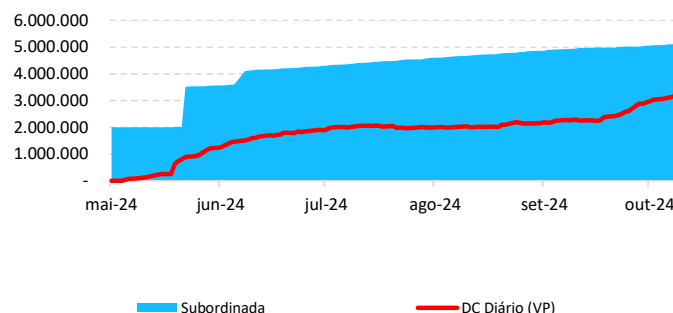
Posição Carteira e Classes

|                            | mai/24 | jun/24 | jul/24 | ago/24 | set/24 | out/24 | nov/24 | dez/24 | jan/25 | fev/25 | mar/25 | abr/25 |
|----------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Direitos Creditórios       | 90     | 1.467  | 2.005  | 2.004  | 2.274  | 3.170  | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Caixa                      | 1.912  | 2.153  | 2.265  | 2.574  | 2.634  | 2.069  | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Títulos Públicos           | -      | -      | 150    | 152    | 153    | 155    | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Crédito vencido e não pago | -      | 0,4    | 141    | 400    | 655    | 967    | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| PDD                        | -      | -      | 5      | 21     | 78     | 224    | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| PL Sênior                  | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| PL Mezanino B              | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| PL Subordinada             | 2.000  | 3.602  | 4.375  | 4.662  | 4.918  | 5.117  | -      | -      | -      | -      | -      | -      |
| Patrimônio Líquido         | 2.000  | 3.602  | 4.375  | 4.662  | 4.918  | 5.117  | -      | -      | -      | -      | -      | -      |

Distribuição Patrimônio Líquido

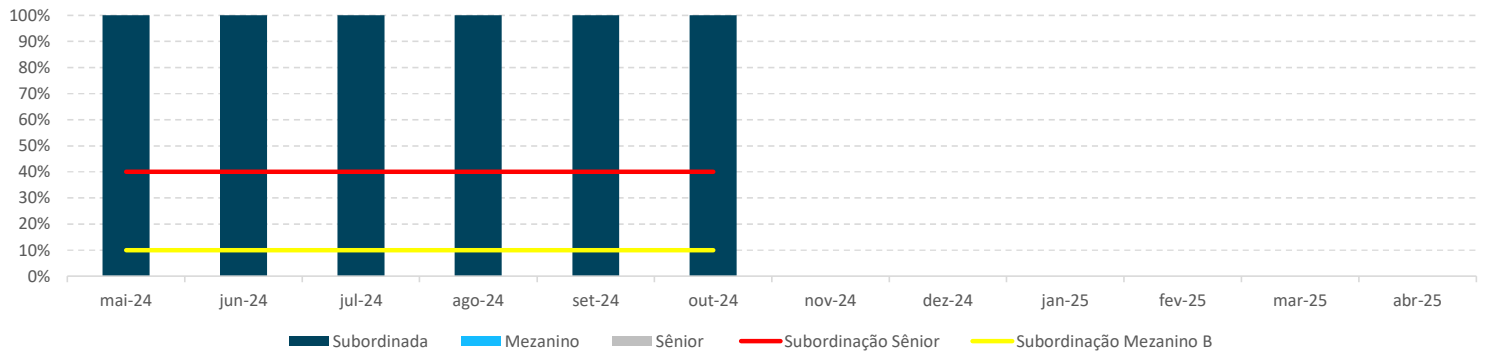


Evolução Patrimonial



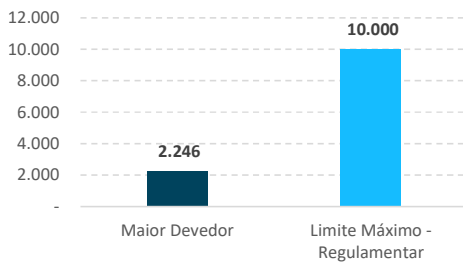


### Distribuição Passivo

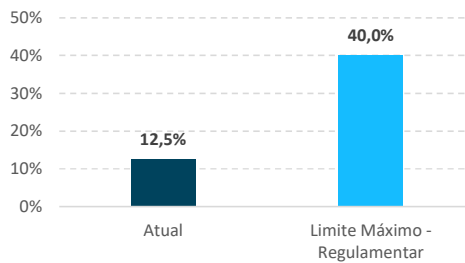


### Índices de Acompanhamento

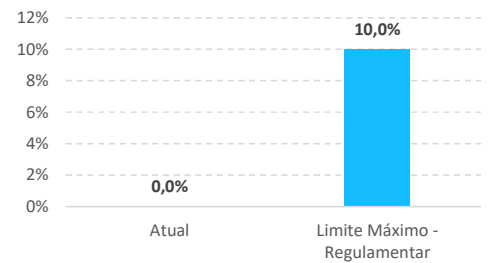
#### Maior Concentração



#### Índice de Atraso

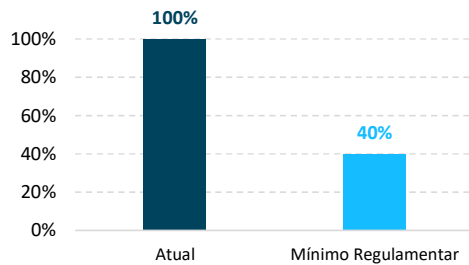


#### Índice de Indenização

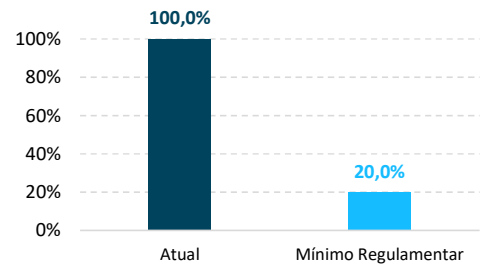


### Índices de Subordinação

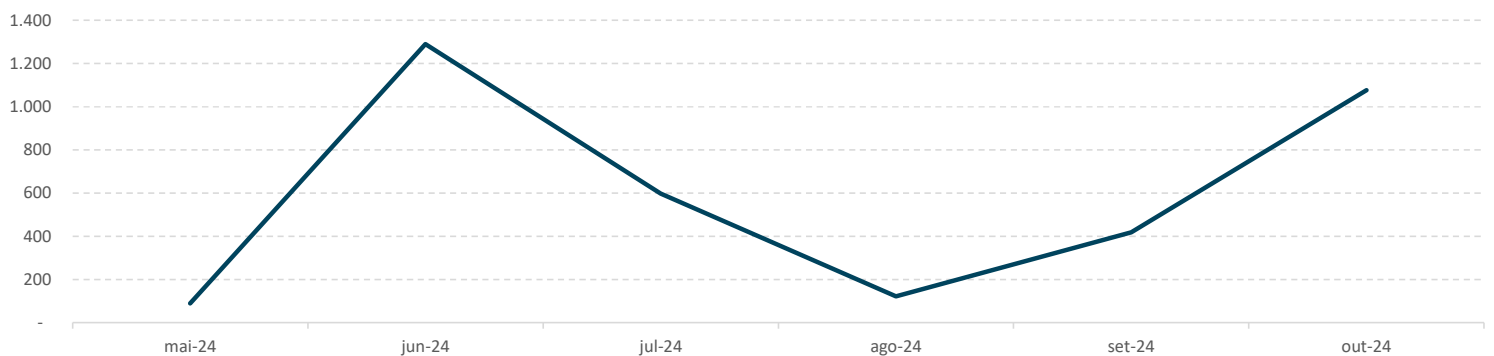
#### Subordinação Sênior



#### Subordinação Mezanino B

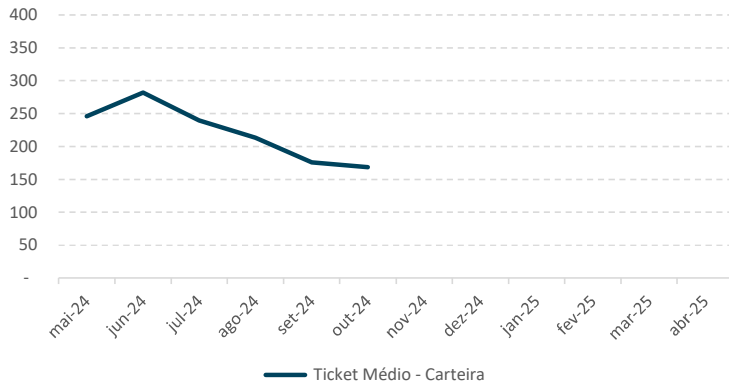


### Volume Operado - R\$ mil

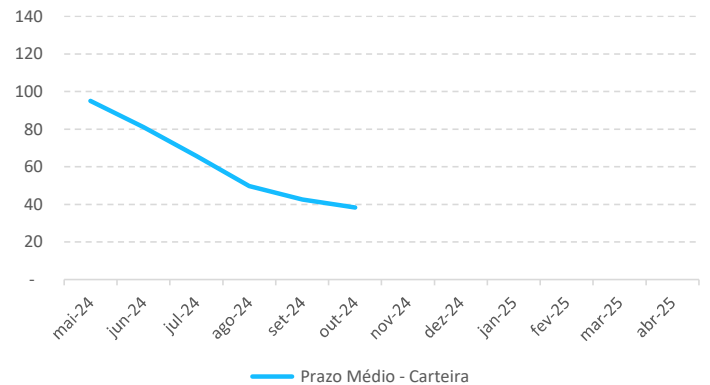




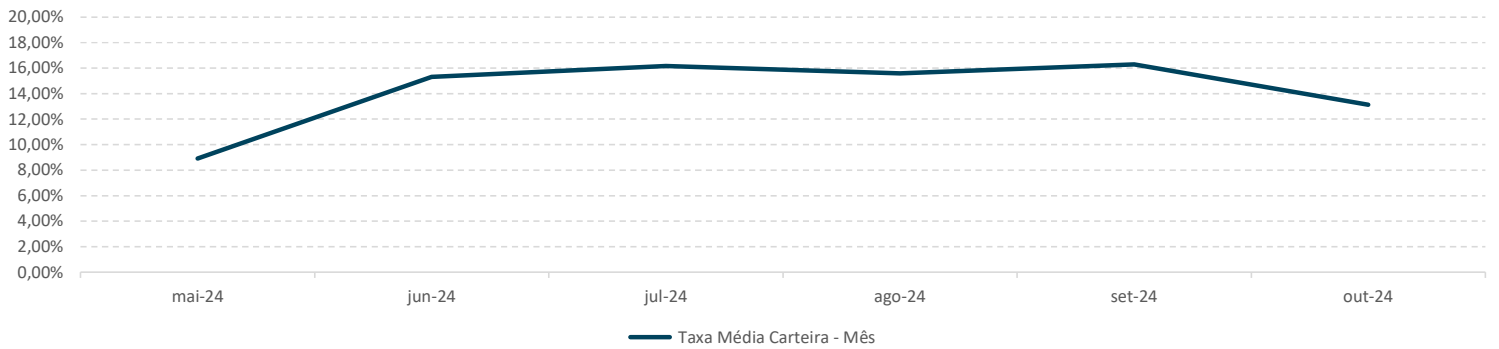
### Ticket Médio - R\$



### Prazo Médio - Dias



### Taxa Média Aquisição - Mês



### Cronograma de Vencimento

