

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.

Julho/24

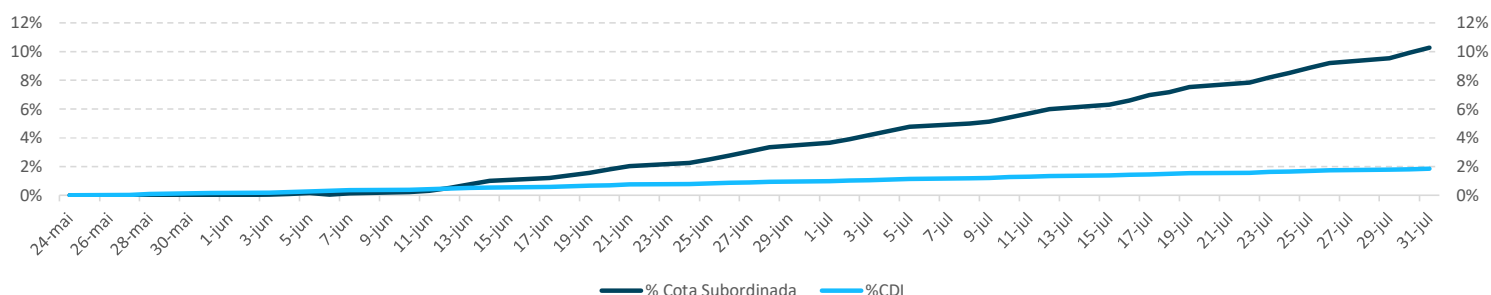
INFORMAÇÕES GERAIS

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%						10,27%	10,27%
%CDI					16%	421%	739%						552%	552%

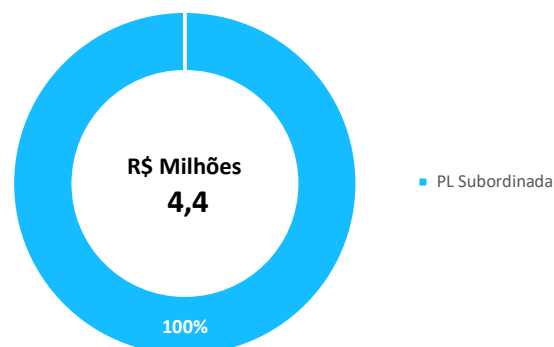


Valores das tabelas em R\$ mil

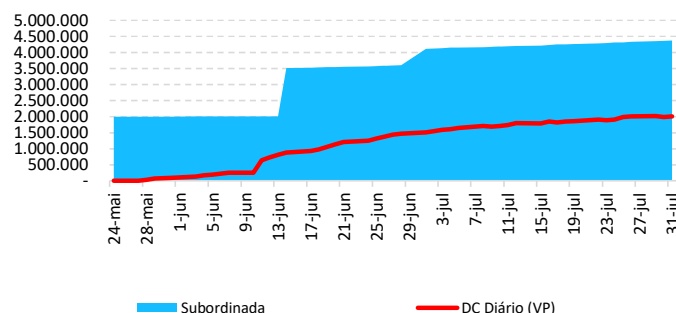
Posição Carteira e Classes

	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									
Caixa	1.912	2.153	2.265									
Títulos Públicos	-	-	150									
Crédito vencido e não pago												
PDD	-	0,4	141									
PL Sênior	-	-	-									
PL Mezanino B	-	-	-									
PL Subordinada	2.000	3.602	4.375									
Patrimônio Líquido	2.000	3.602	4.375									

Distribuição Patrimônio Líquido

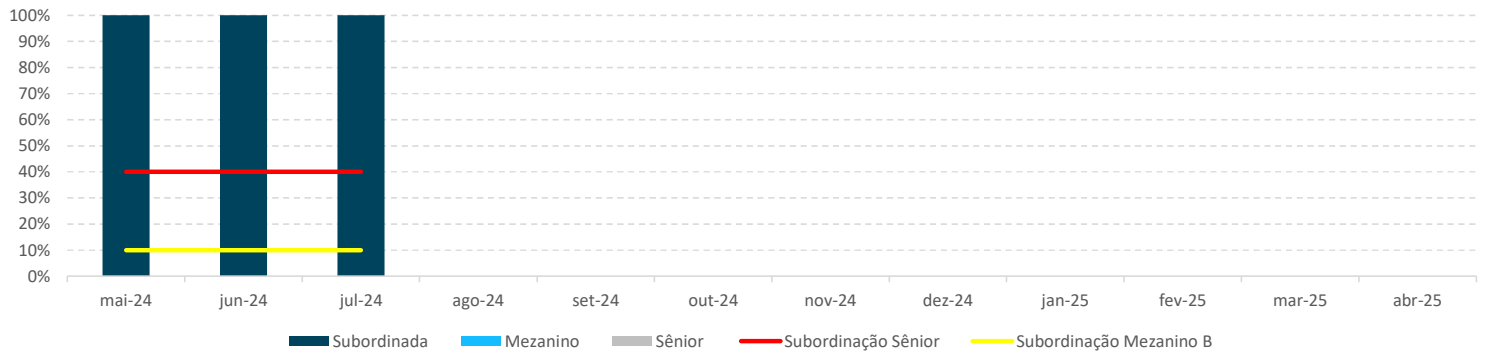


Evolução Patrimonial



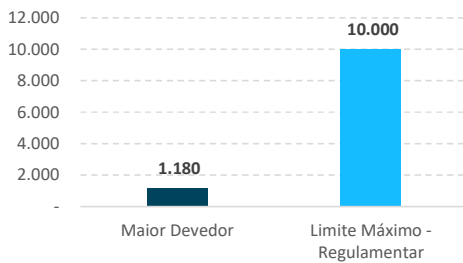


Distribuição Passivo

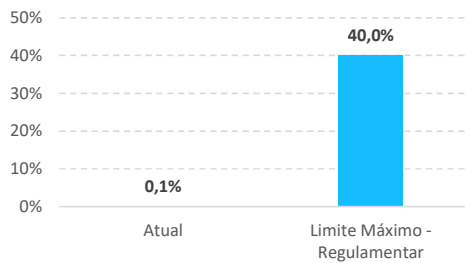


Índices de Acompanhamento

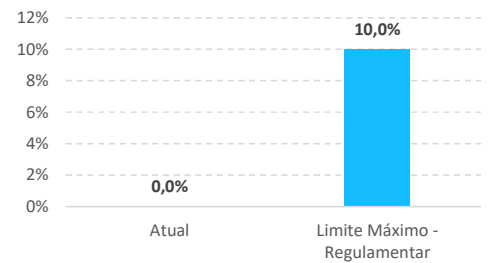
Maior Concentração



Índice de Atraso

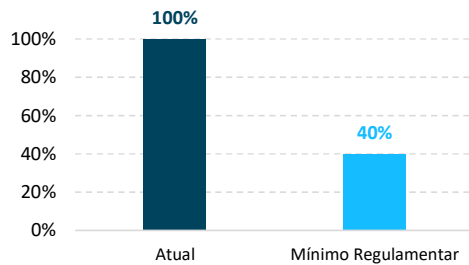


Índice de Indenização

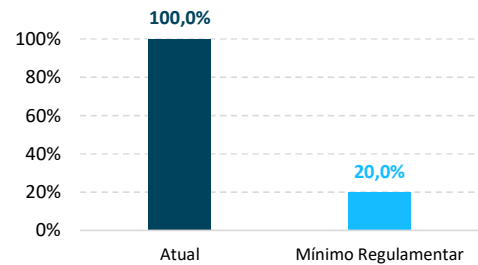


Índices de Subordinação

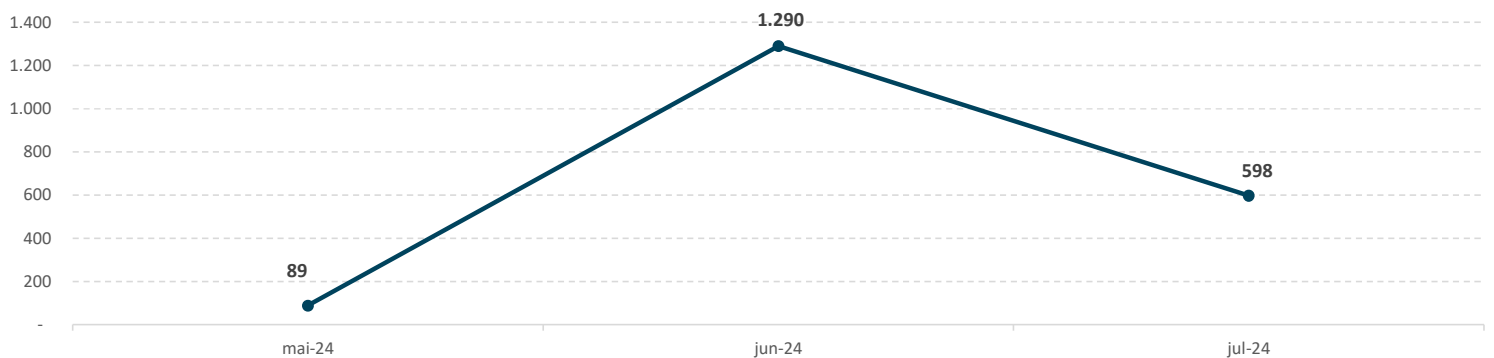
Subordinação Sênior



Subordinação Mezanino B

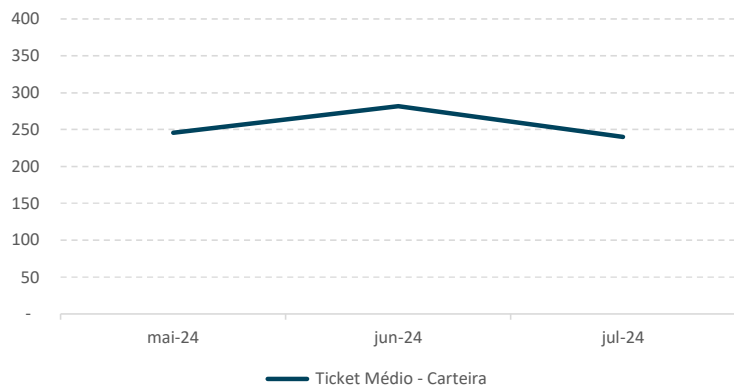


Volume Operado - R\$ mil

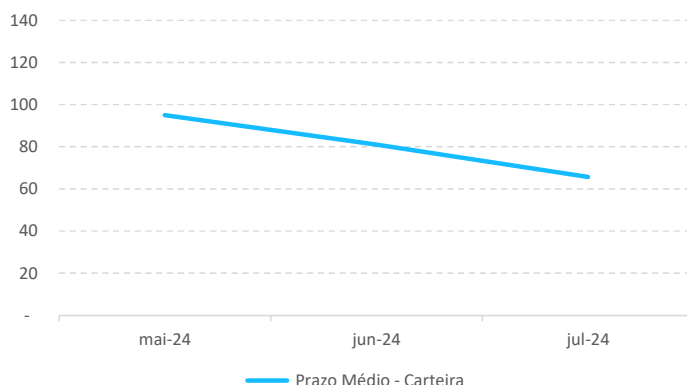




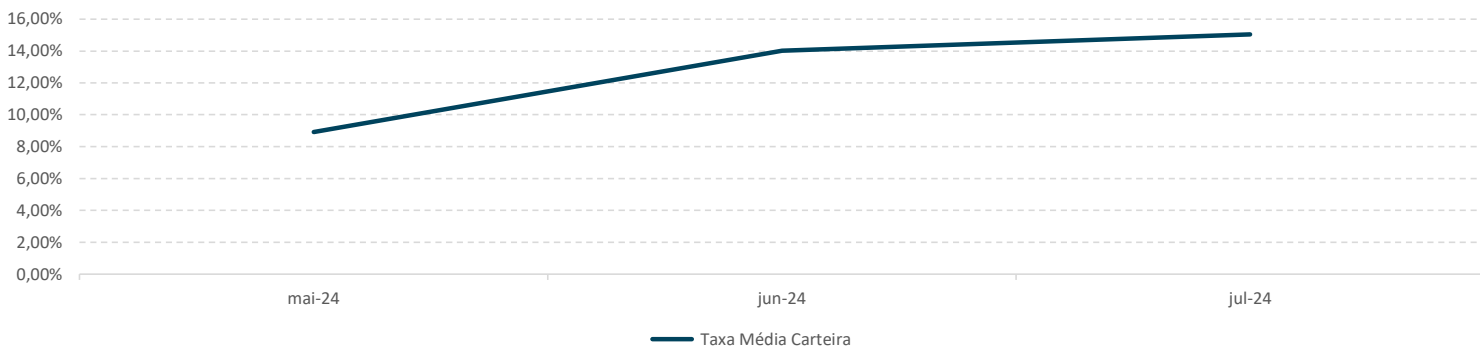
Ticket Médio - R\$



Prazo Médio - Dias



Taxa Média - Carteira



Cronograma de Vencimento

