

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.

Novembro/24

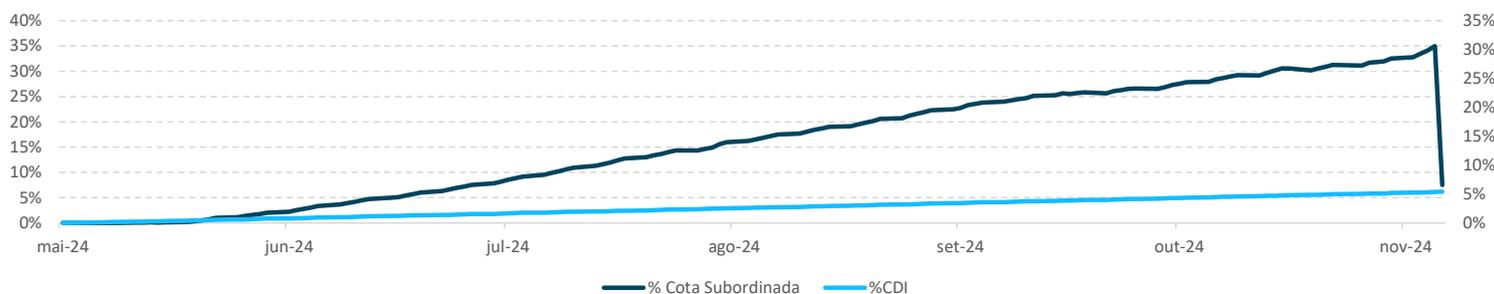
INFORMAÇÕES GERAIS

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%	-16,66%	-	7,50%	7,50%
%CDI	-	-	-	-	16%	421%	739%	756%	658%	437%	-	-	139%	139%

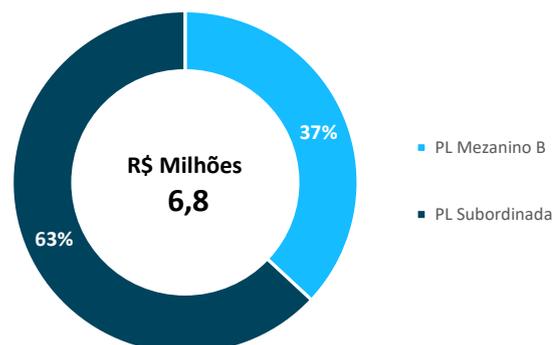


Valores das tabelas em R\$ mil

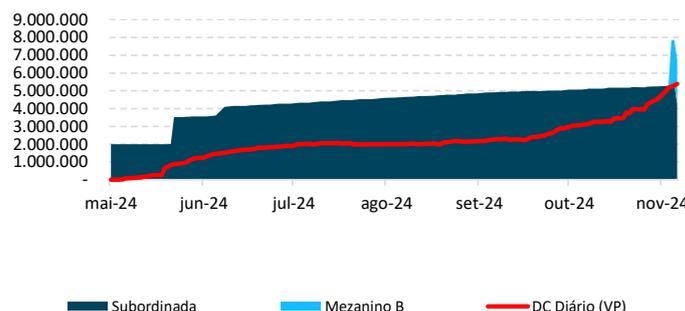
Posição Carteira e Classes

	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	5.392	-	-	-	-	-
Caixa	1.912	2.153	2.265	2.574	2.634	2.069	2.877	-	-	-	-	-
Títulos Públicos	-	-	150	152	153	155	156	-	-	-	-	-
Crédito vencido e não pago	-	0,4	141	400	655	967	1.334	-	-	-	-	-
PDD	-	-	5	21	78	224	1.548	-	-	-	-	-
PL Sênior	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PL Mezanino B	-	-	-	-	-	-	2.504	-	-	-	-	-
PL Subordinada	2.000	3.602	4.375	4.662	4.918	5.117	4.265	-	-	-	-	-
Patrimônio Líquido	2.000	3.602	4.375	4.662	4.918	5.117	6.768	-	-	-	-	-

Distribuição Patrimônio Líquido

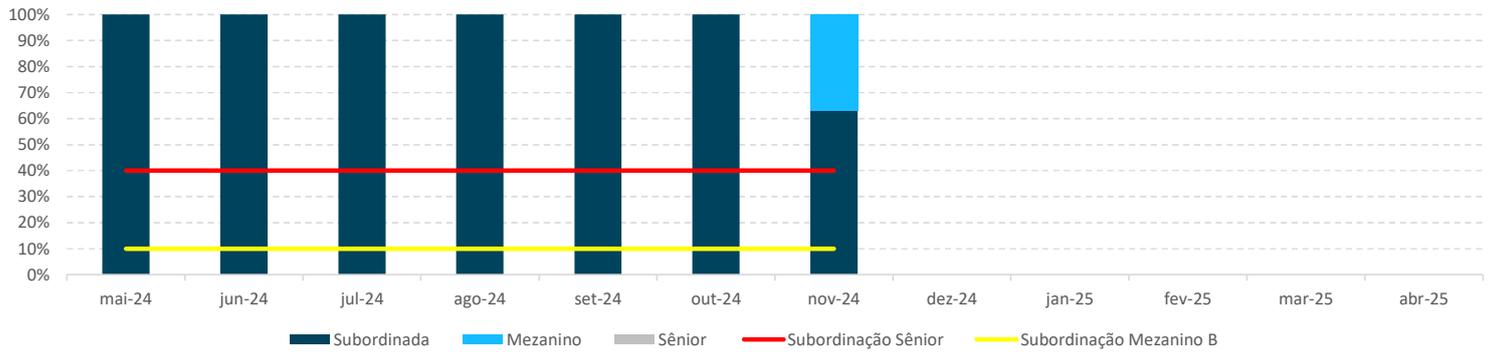


Evolução Patrimonial



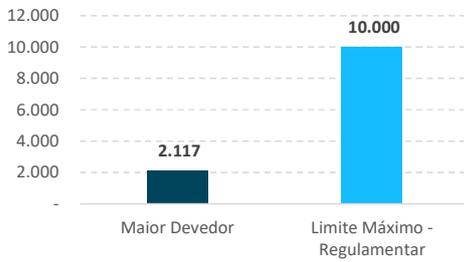


Distribuição Passivo

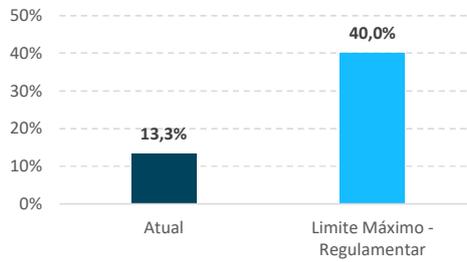


Índices de Acompanhamento

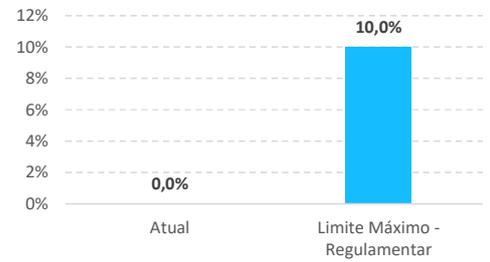
Maior Concentração



Índice de Atraso

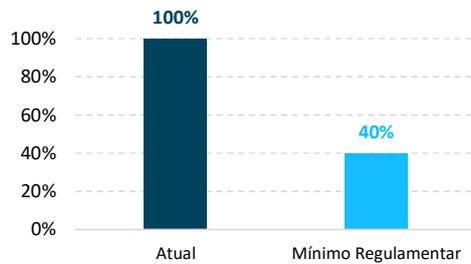


Índice de Indenização

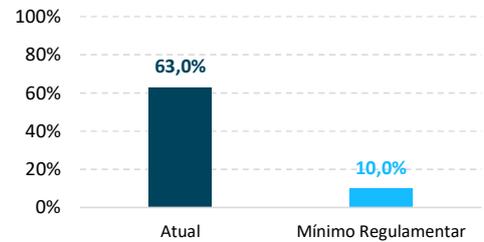


Índices de Subordinação

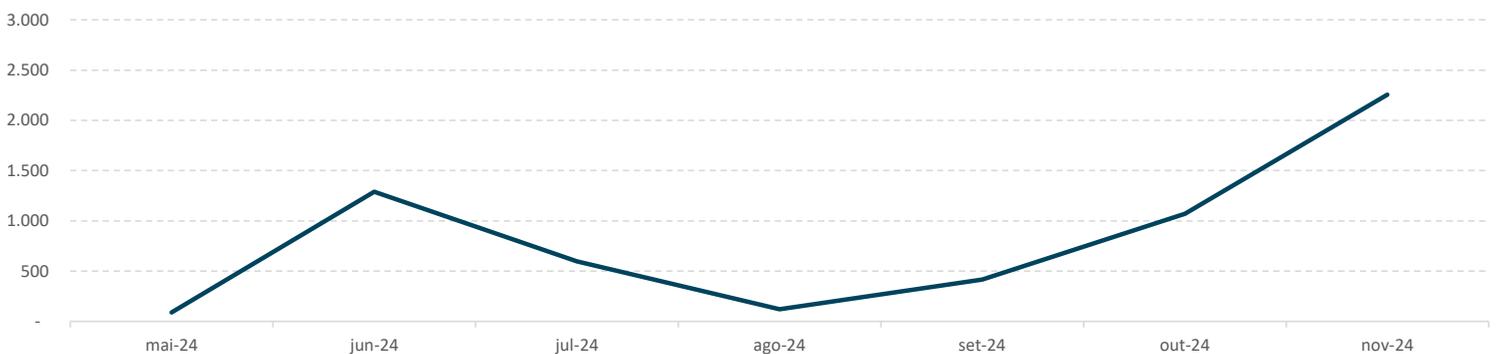
Subordinação Sênior



Subordinação Mezanino B

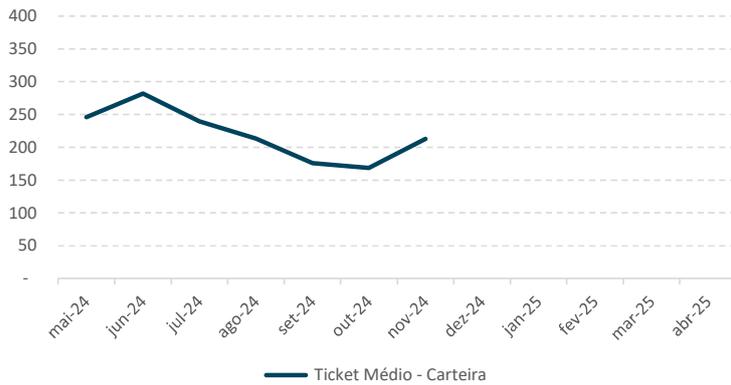


Volume Operado - R\$ mil

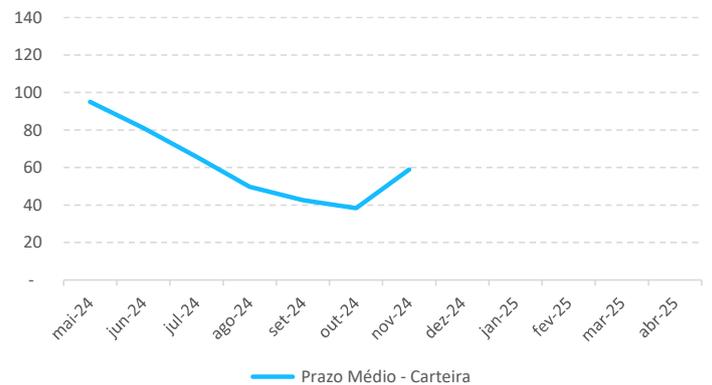




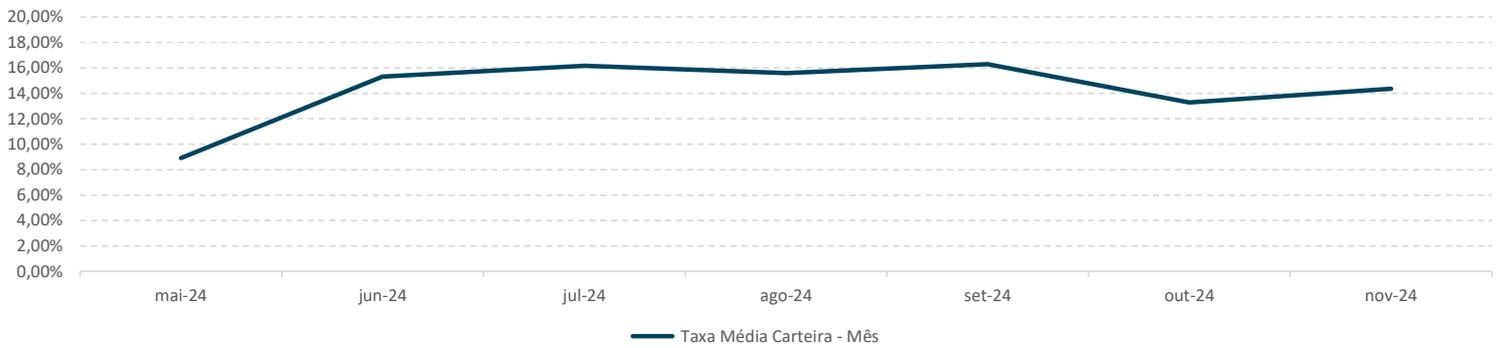
Ticket Médio - R\$



Prazo Médio - Dias



Taxa Média Aquisição - Mês



Cronograma de Vencimento

