

RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

Dezembro/2024

OBJETIVO

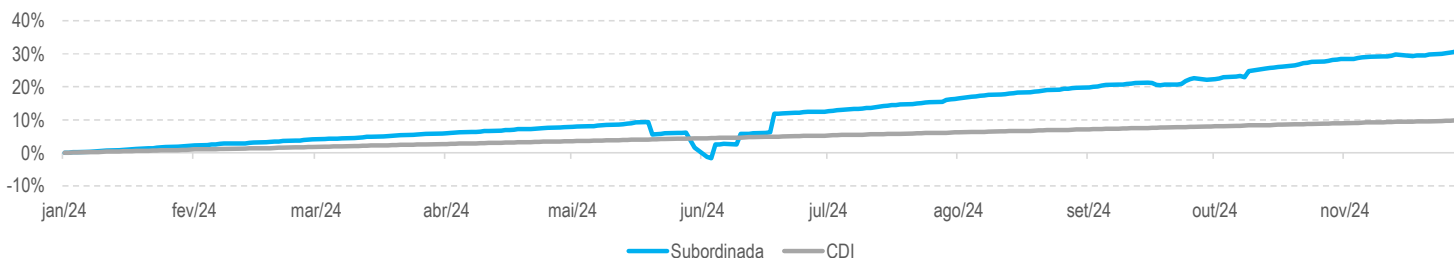
O Fundo tem como objetivo proporcionar aos Cotistas a valorização das suas Cotas por meio da aplicação de recursos, preponderantemente, nos Direitos Creditórios, observada a Política de Investimento do Fundo.

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%	3,08%	1,99%	5,03%	2,30%	2,22%	34,12%	34,12%
	%CDI	222%	236%	202%	220%	-	1354%	372%	355%	238%	542%	291%	239%	315%	315%



Valores das tabelas em R\$ mil

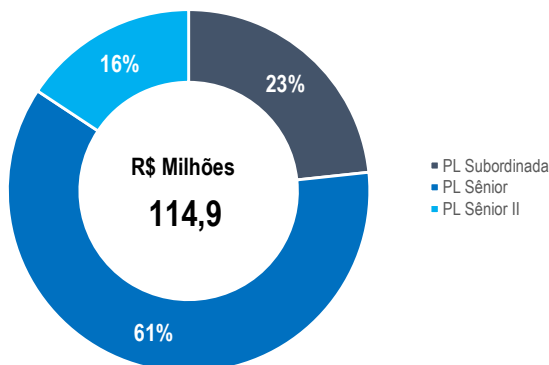
Posição Carteira e Classes

	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	90.696	93.667	93.712	95.090	108.048
Caixa	502	5.483	15.117	15.636	7.803	1.081	3.068	3.123	822	1.799	865	6.866
Títulos Públicos	301	303	306	309	311	314	316	319	322	325	328	331

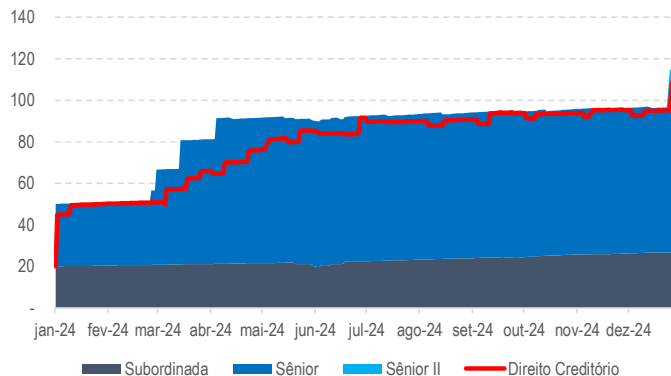
	jan/24	fev/24	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	set/24	out/24	nov/24	dez/24
Crédito Vencido e não pago	-	-	-	361	974	111	48	65	226	147	246	404
PDD	-	-	11	60	1.830	99	27	90	324	23	49	271

	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	69.997	69.960	70.046	69.889	70.000
Sênior II	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	18.035
Mezanino	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Subordinada	20.424	20.810	21.161	21.573	20.152	22.491	23.249	23.965	24.441	25.670	26.261	26.843
Patrimônio Líquido	50.824	56.573	81.116	91.577	90.149	92.406	93.287	93.962	94.402	95.716	96.150	114.877

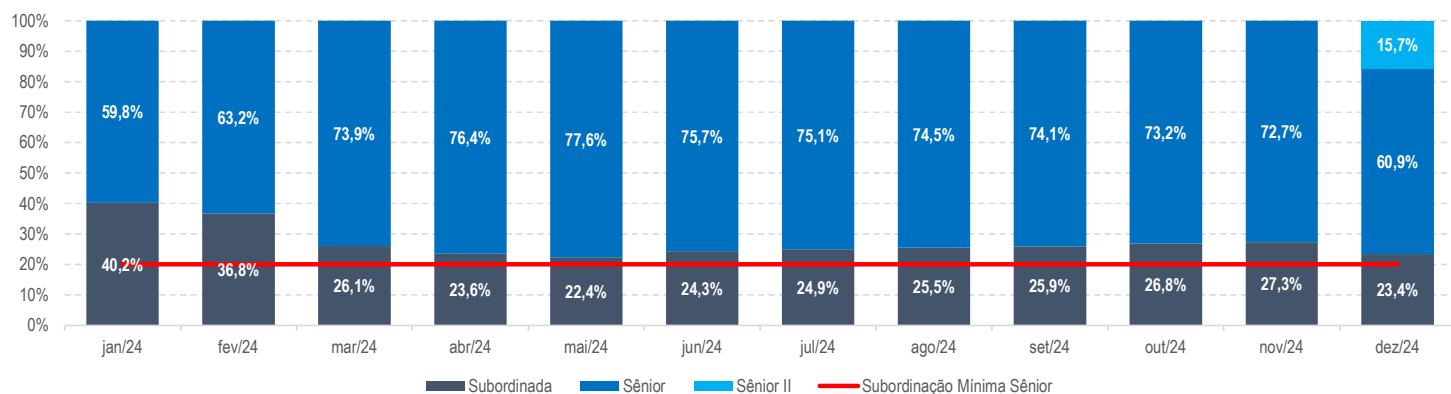
Distribuição Patrimônio Líquido



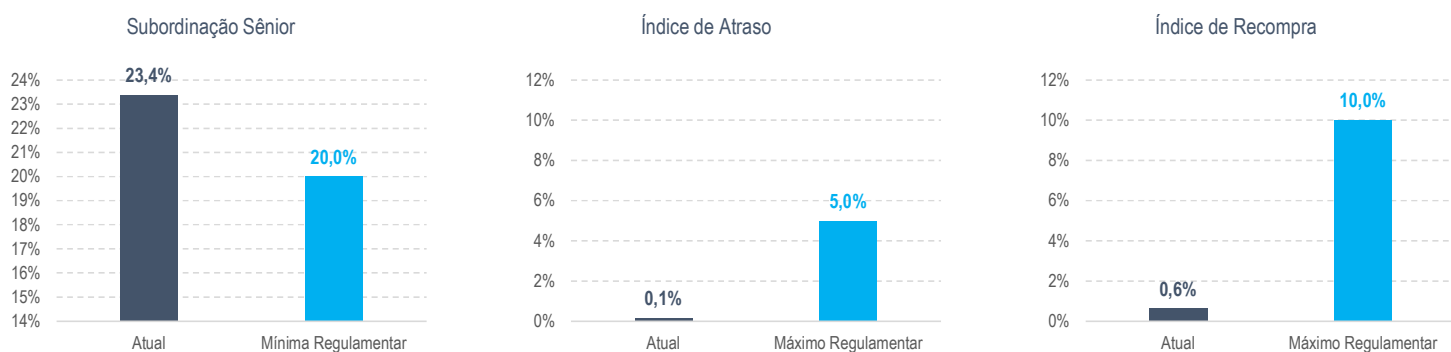
Evolução Patrimonial - R\$ milhões



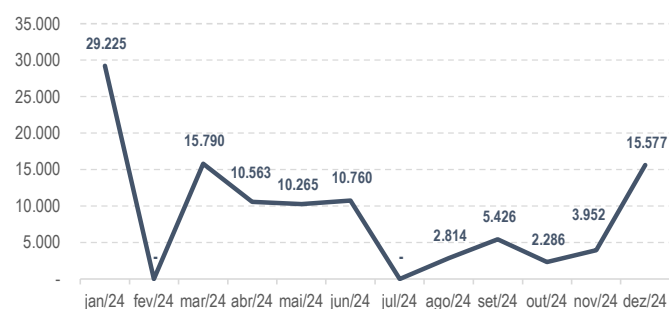
Passivo e Índice de Subordinação



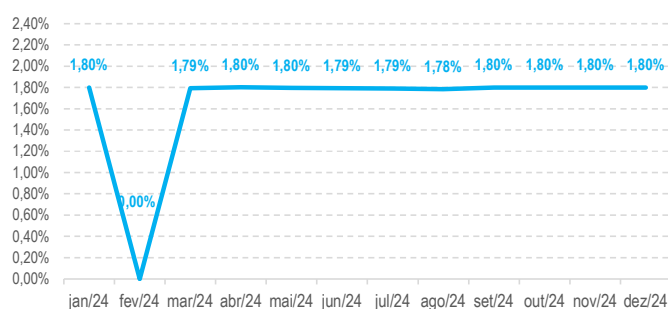
Índices de Acompanhamento



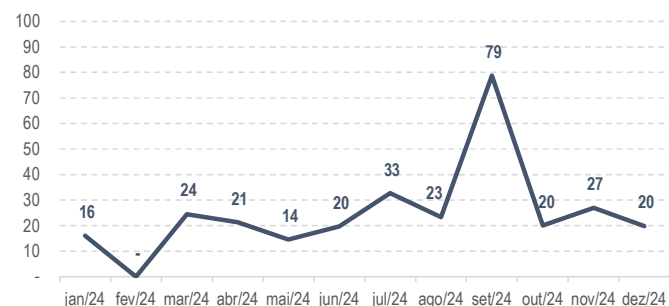
Volume Operado - R\$ mil



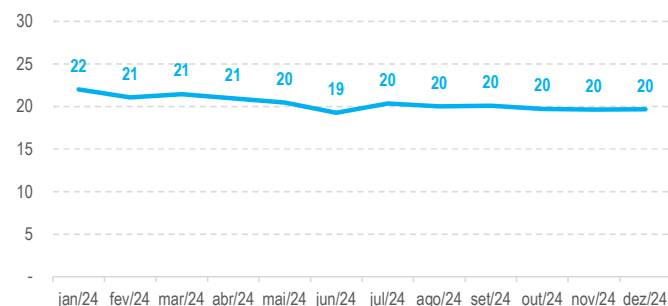
Taxa média aquisição - Carteira



Ticket médio mês - R\$ mil



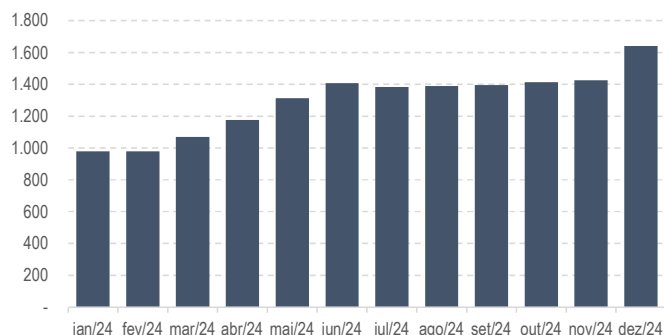
Prazo médio - Meses



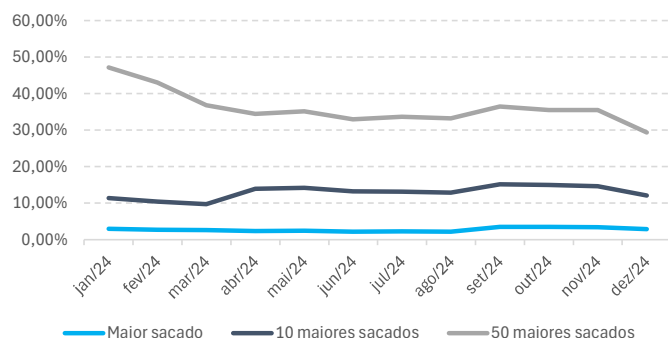
* Não houve operação em fevereiro de 2024.



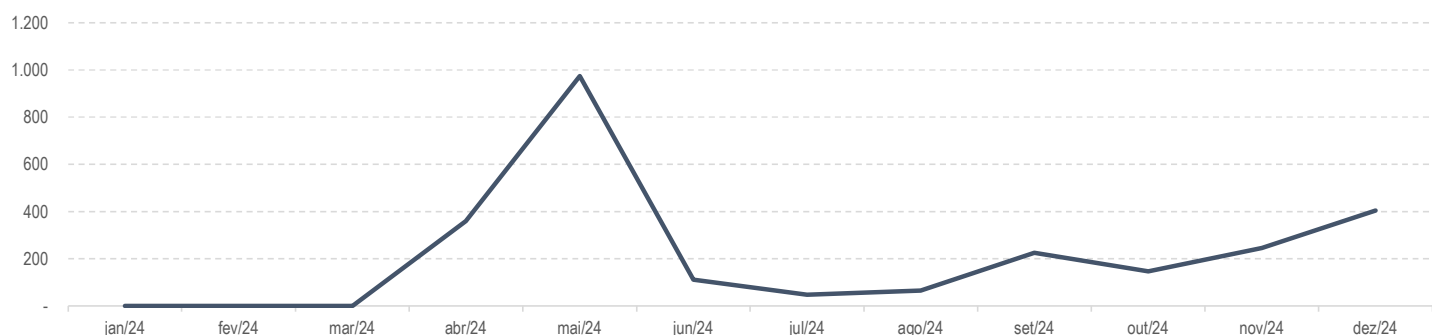
Quantidade de sacados



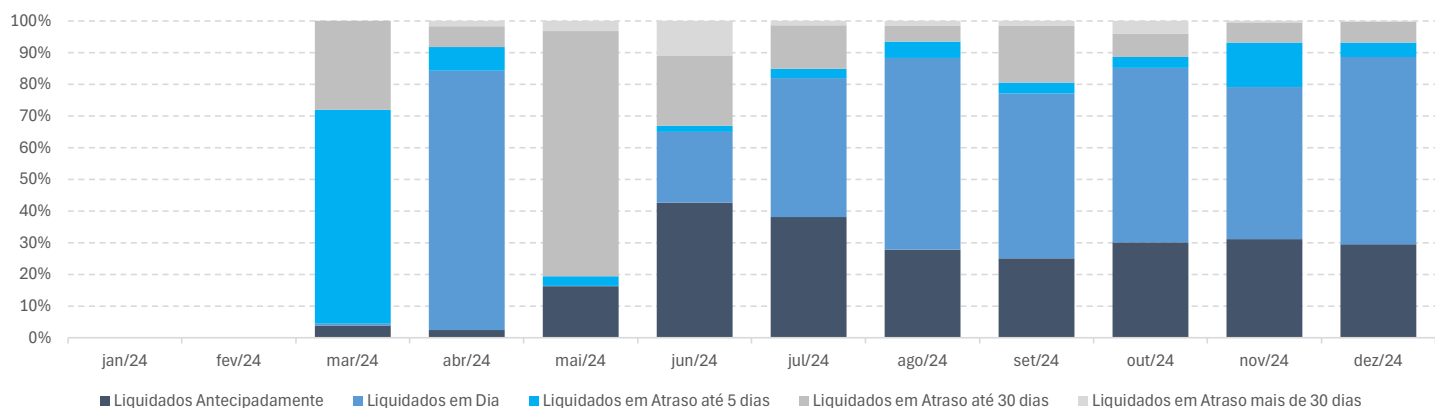
Concentração dos sacados



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



Comportamento das Liquidações dos Títulos (R\$ mil)



Cronograma de Vencimento - R\$ mil

