

RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

Fevereiro/2025

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.

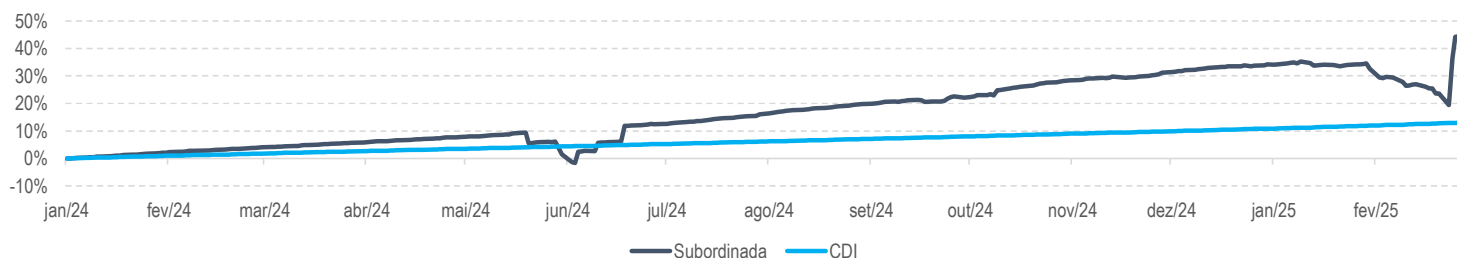
INFORMAÇÕES GERAIS

Início do Fundo	02/01/2024
Administrador	Banco Daycoval S.A.
Gestor	Valora Gestão de Investimentos Renda Fixa LTDA
Custodiante	Banco Daycoval S.A.

Classe	Rentabilidade Alvo	Rating	Carência	Amortização	Vencimento
Sênior	CDI + 5,00% a.a.		12 meses de principal	36 PMTs a partir de 01/2025	dez/27
Sênior II	CDI + 4,75% a.a.		6 meses de principal	36 PMTs a partir de 07/2025	jun/28
Mezanino	CDI + 7,75% a.a.		6 meses de principal	36 PMTs a partir de 07/2025	jun/28

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%
2025	Fundo	-1,13%	9,10%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	7,86%	44,66%
	%CDI	-	923%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	392%	342%

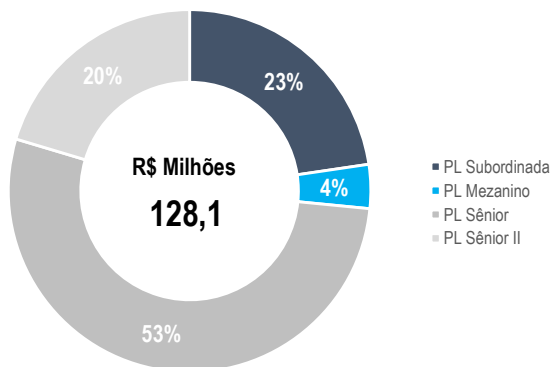


Valores das tabelas em R\$ mil

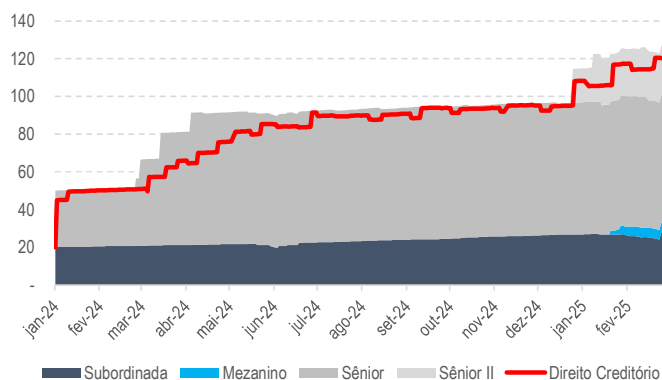
Posição Carteira e Classes

	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	65.801	75.818	84.100	91.029	89.915	90.696	93.667	93.712	95.090	108.048	117.241	120.508
Caixa	15.117	15.636	7.803	1.081	3.068	3.123	822	1.799	865	6.866	9.387	7.427
Títulos Públicos	306	309	311	314	316	319	322	325	328	331	335	338
Crédito Vencido e não pago	-	361	974	111	48	65	226	147	246	404	465	178
PDD	11	60	1.830	99	27	90	324	23	49	271	1.594	30
Sênior	59.955	70.004	69.997	69.915	70.038	69.997	69.960	70.046	69.889	70.000	69.036	67.987
Sênior II	-	-	-	-	-	-	-	-	-	18.035	25.153	26.105
Mezanino	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Subordinada	21.161	21.573	20.152	22.491	23.249	23.965	24.441	25.670	26.261	26.843	26.540	29.006
Patrimônio Líquido	81.116	91.577	90.149	92.406	93.287	93.962	94.402	95.716	96.150	114.877	125.247	128.121

Distribuição Patrimônio Líquido

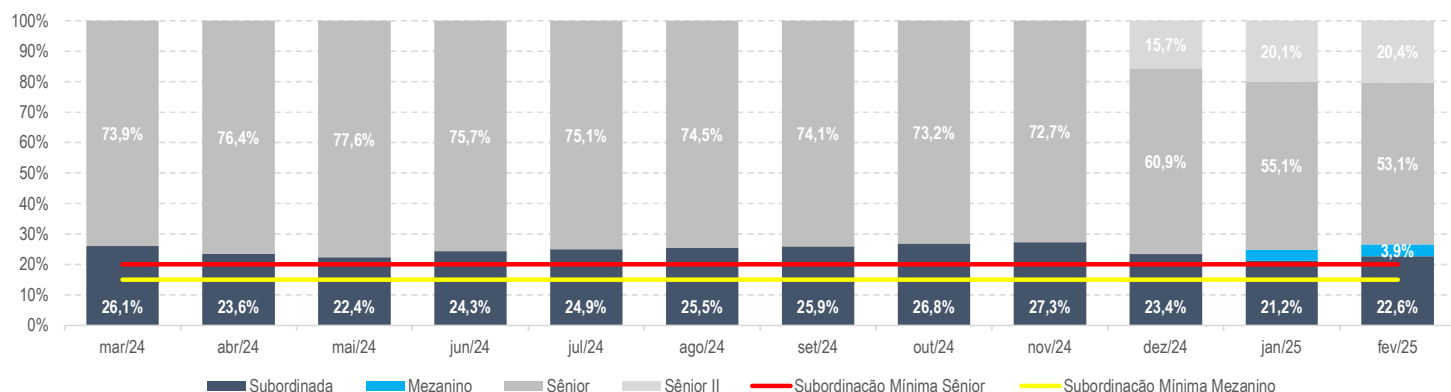


Evolução Patrimonial - R\$ milhões

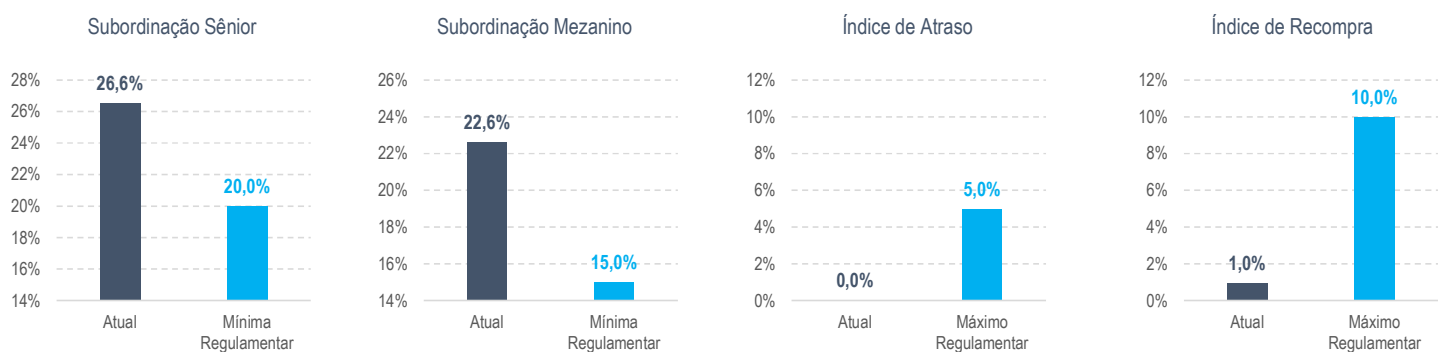




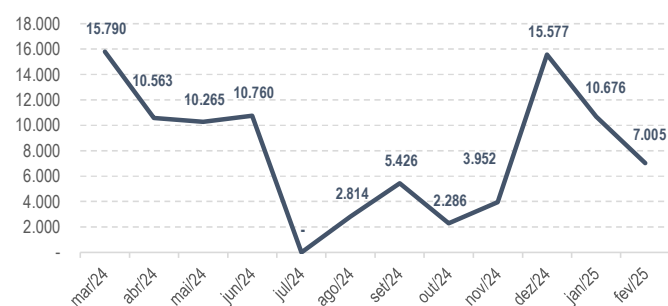
Passivo e Índice de Subordinação



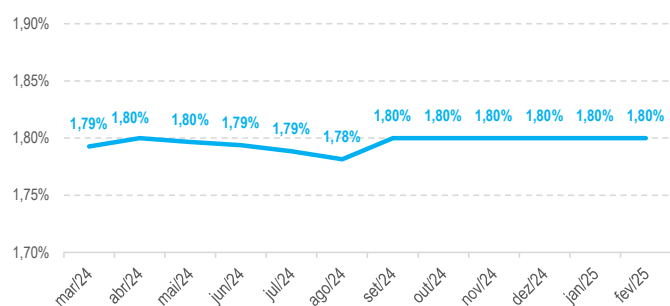
Índices de Acompanhamento



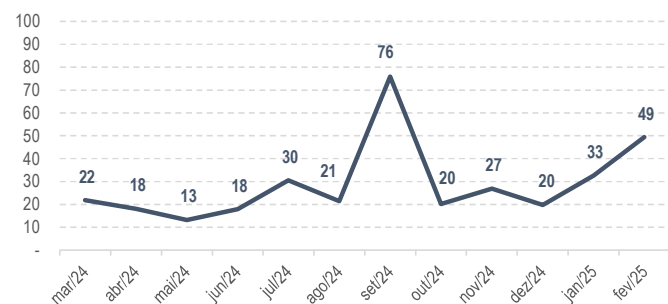
Volume Operado - R\$ mil



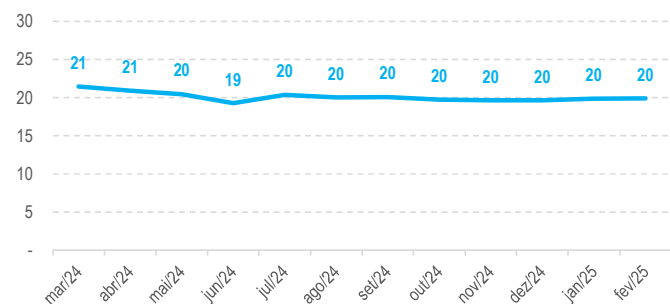
Taxa média aquisição - Carteira



Ticket médio mês - R\$ mil

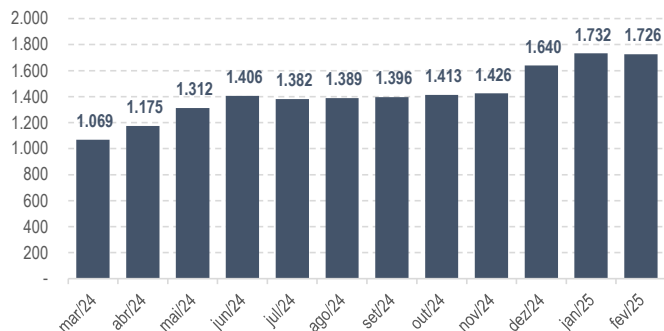


Prazo médio - Meses

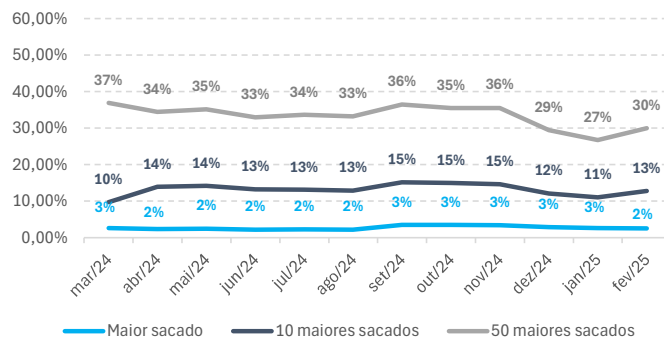




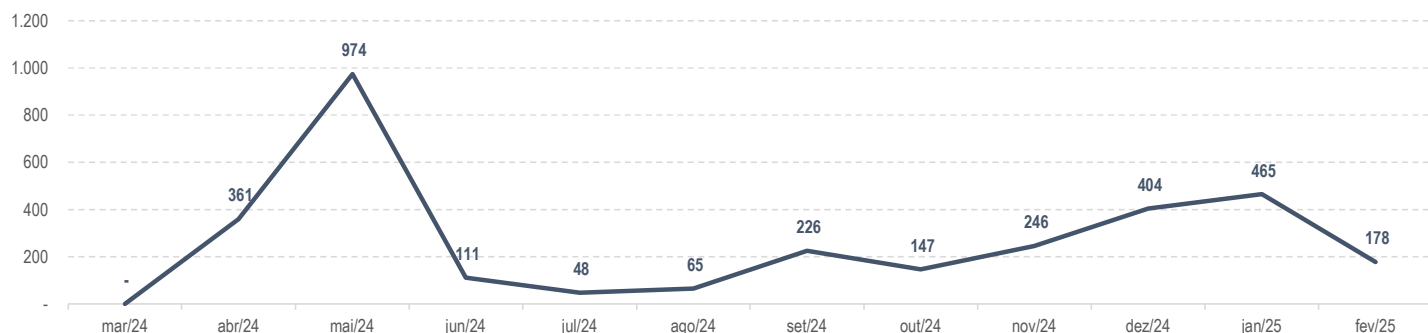
Quantidade de sacados



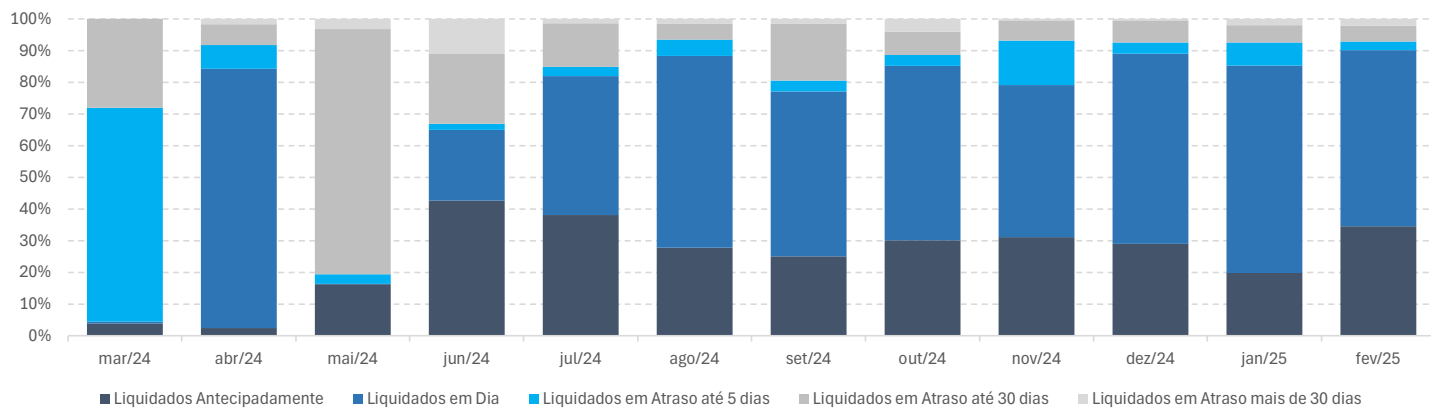
Concentração dos sacados



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



Comportamento das Liquidações dos Títulos (R\$ mil)



Cronograma de Vencimento - R\$ mil

