



RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO

OBJETIVO

Proporcionar aos Cotistas a valorização das suas Cotas por meio da aplicação de recursos, preponderantemente, nos Direitos Creditórios, observada a política de investimento da Classe.

Novembro/24

INFORMAÇÕES GERAIS

Início do Fundo	01/03/2024
Administrador	Banco Daycoval S.A.
Gestor	Valora Gestão de Investimentos Renda Fixa LTDA
Custodiante	Banco Daycoval S.A.
Agência de Rating	Austin Rating

Classe	Rating	Rentabilidade Alvo	Carência	Juros/Remuneração	Amortização	Vencimento
Sênior	'brAA(sf)'	CDI + 3,50% a.a.	36 meses de principal	Pagamento mensal a partir de abr/24	36 PMTS a partir de mar/27	15/02/2030
Mezanino	-	CDI + 4,75% a.a.	36 meses de principal	Pagamento mensal a partir de abr/24	36 PMTS a partir de mar/27	15/02/2030

Rentabilidade Cota Subordinada Júnior

		jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Ano	Acum.
2024	Fundo	-	-	-0,98%	-2,03%	4,41%	0,83%	1,36%	1,79%	-0,39%	1,31%	1,25%	-	7,67%	7,67%
	%CDI	-	-	-	-	530%	105%	150%	206%	-	141%	158%	-	97%	97%

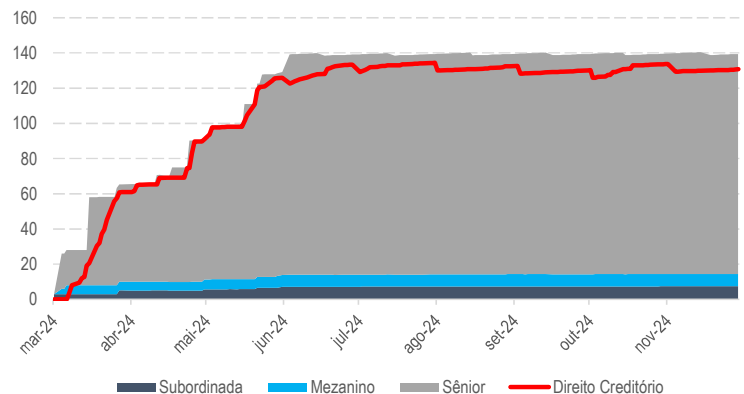
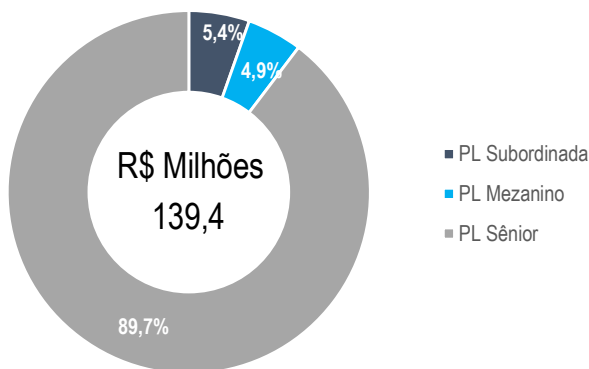
Fechamento de Mês (R\$ - Mil)

	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	60.826	90.891	125.767	133.356	134.378	132.506	129.994	133.640	130.651	-	-	-
Caixa (Fundos de zeragem)	4.595	947	3.226	5.740	5.092	6.933	9.453	6.047	8.804	-	-	-
Títulos Públicos	-	-	148	149	150	152	153	155	156	-	-	-

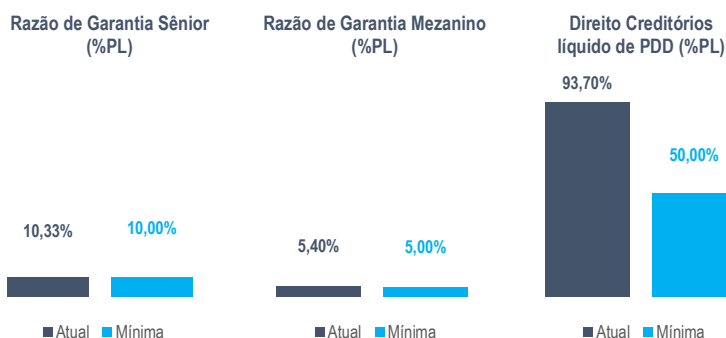
	mar/24	abr/24	mai/24	jun/24	jul/24	ago/24	set/24	out/24	nov/24	dez/24	jan/25	fev/25
Sênior	55.355	80.412	115.117	125.045	125.244	125.178	125.125	125.263	125.011	-	-	-
Mezanino	5.052	5.632	6.879	6.875	6.887	6.883	6.880	6.888	6.873	-	-	-
Subordinada	4.973	5.672	7.083	7.142	7.239	7.369	7.340	7.436	7.529	-	-	-
PL	65.379	91.716	129.079	139.062	139.370	139.430	139.344	139.587	139.413	-	-	-

Patrimônio Líquido e Cotas

Evolução Patrimonial (R\$ milhões)



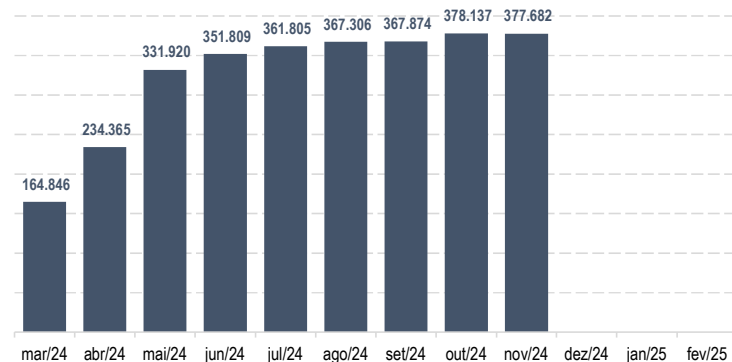
Fechamento de Mês (R\$ - Mil)



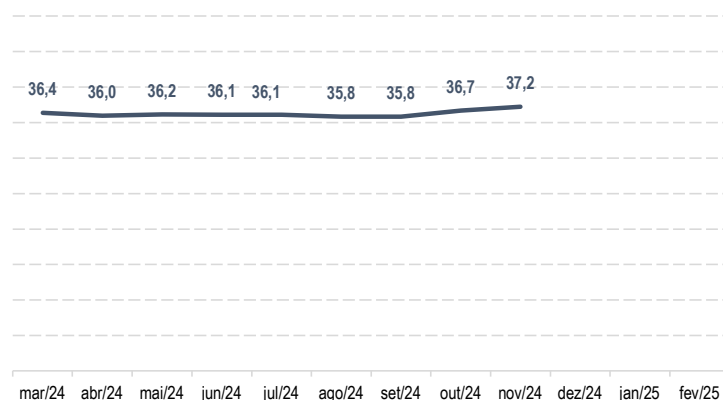
Índice de Cobertura Sênior	>=1	1,008 Enquadrado
Índice de Cobertura Mezanino	>=1	1,005 Enquadrado
Índice de Resolução de Cessão	<=1%	0,00% Enquadrado
Índice de Pré-Pagamento	<=3%	0,02% Enquadrado
Índice de Atraso	<=10%	0,02% Enquadrado
Índice de Arrecadação	>=93%	100,00% Enquadrado



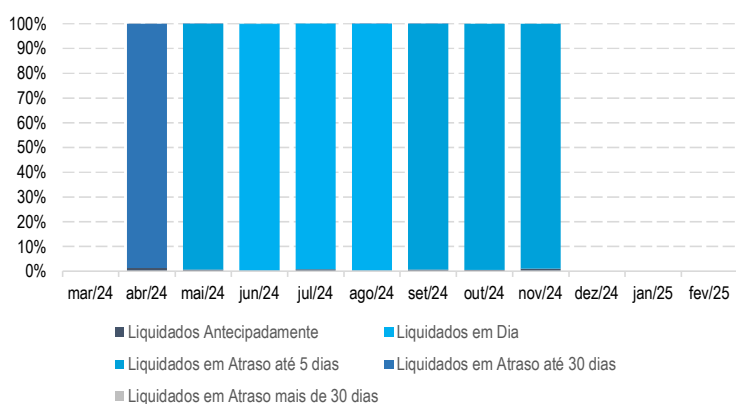
Quantidade de Devedores



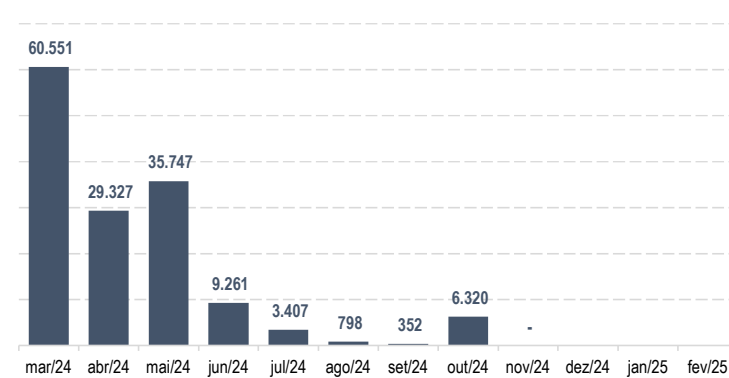
Prazo Médio da Carteira (Meses)



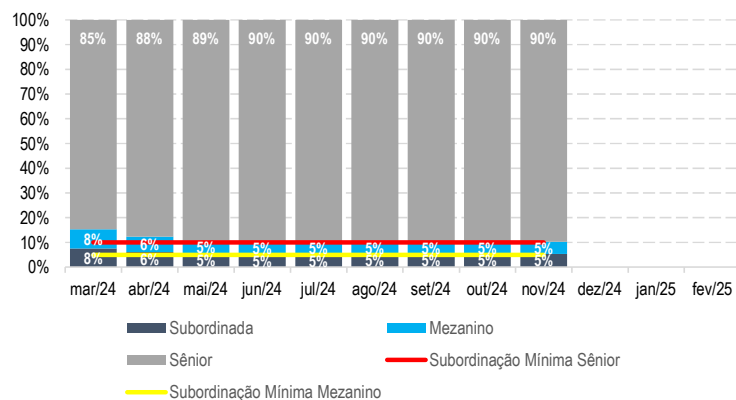
Comportamento das Liquidações dos Títulos (R\$ mil)



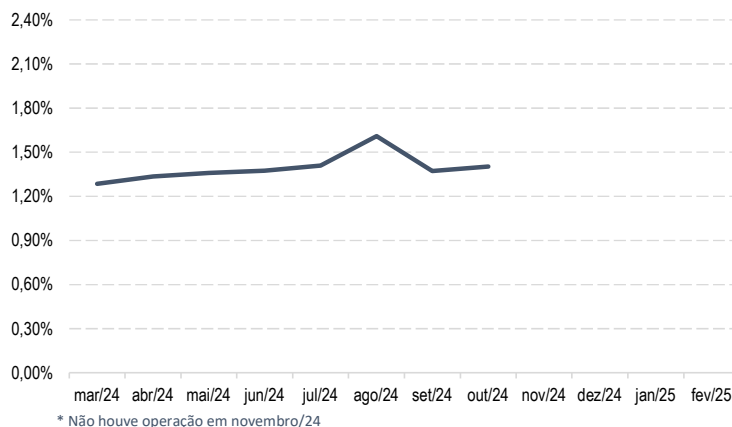
Volume Operado Mensal (R\$ mil)



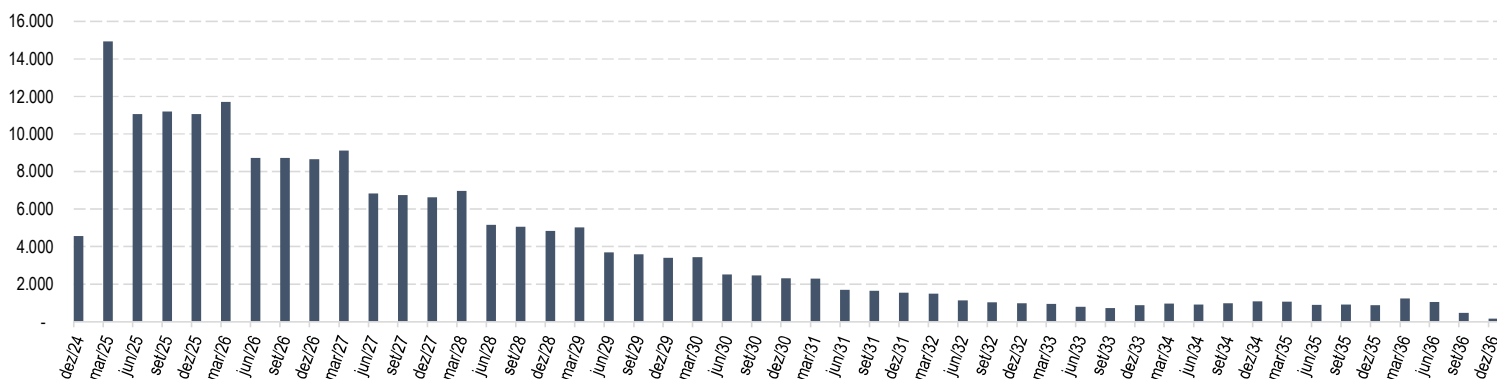
Distribuição de Passivo



Taxa Média Aquisição (a.m.)*



Cronograma de Vencimentos (Acumulado Trimestralmente) - R\$ mil

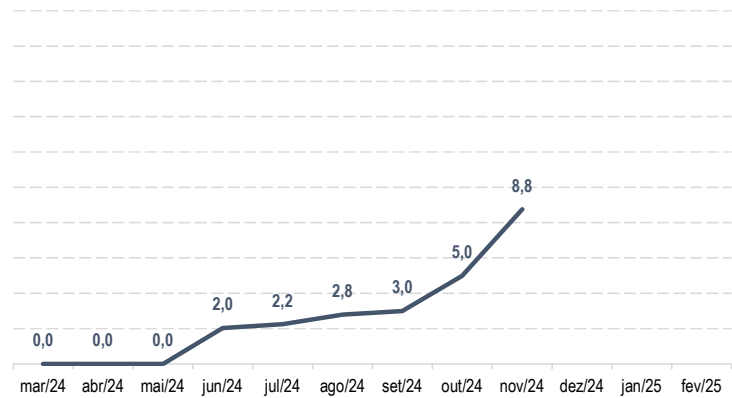


As informações contidas neste material são de caráter exclusivamente informativo. Fundos de investimento não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo Garantidor de Crédito – FGC. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Leia o prospecto, o regulamento e a lâmina de informações essenciais antes de investir. Para avaliação de performance do fundo, é recomendável uma análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Este conteúdo foi elaborado pelo Gestor com fins meramente informativos, não devendo ser considerado como recomendação de investimento ou oferta para aquisição de cotas, nem servir como base única para tomada de decisão de investimento. Quaisquer outras informações ou esclarecimentos sobre o Fundo poderão ser obtidos com o Administrador e o Gestor, através do e-mail ri@valorainvest.com.br.

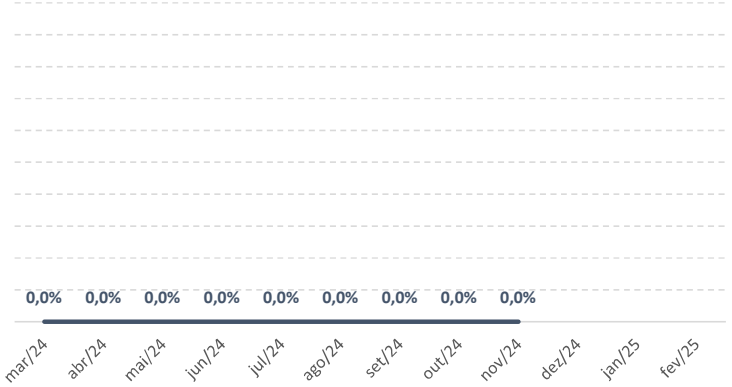




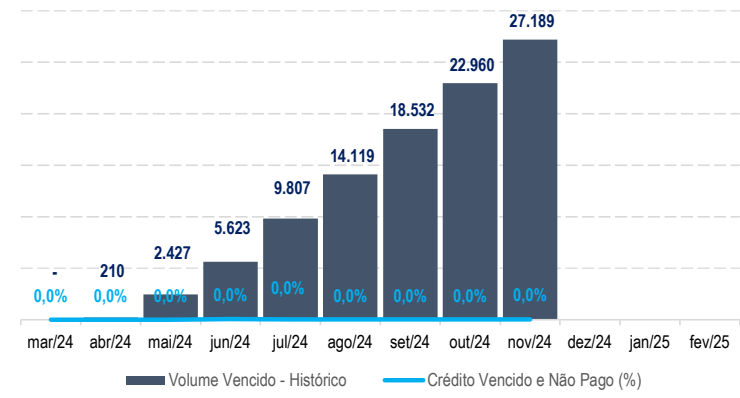
Crédito Vencido e Não Pago Acumulado (R\$ mil)



PDD x Direito Creditório



Crédito Vencido e Não Pago x Vencimento Histórico Acumulado - R\$ mil



PDD x Patrimônio Líquido - R\$ mil

