



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.

Setembro/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%	-	-	-	4,96%	4,96%
	%CDI	-	-	-	-	530%	105%	150%	206%	-	-	-	-	82%	82%

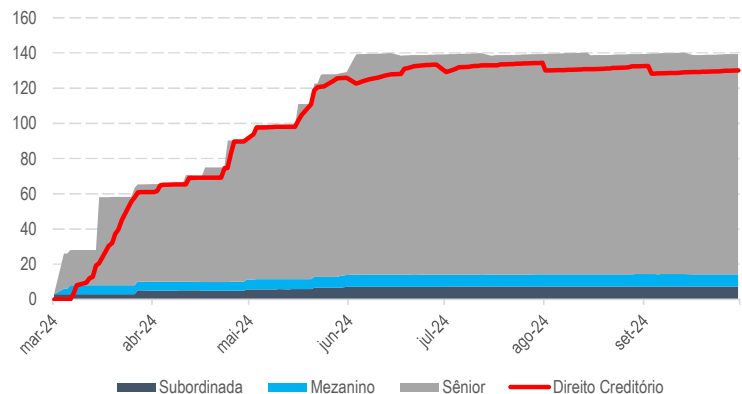
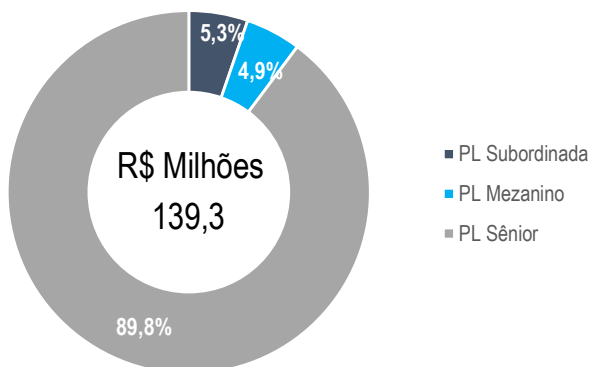
Fechamento de Mês (R\$ - Mil)

	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	-	-	-	-	-
Caixa (Fundos de zeragem)	4.595	947	3.226	5.740	5.092	6.933	9.453	-	-	-	-	-
Títulos Públicos	-	-	148	149	150	152	153	-	-	-	-	-

	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	-	-	-	-	-
Mezanino	5.052	5.632	6.879	6.875	6.887	6.883	6.880	-	-	-	-	-
Subordinada	4.973	5.672	7.083	7.142	7.239	7.369	7.340	-	-	-	-	-
PL	65.379	91.716	129.079	139.062	139.370	139.430	139.344	-	-	-	-	-

Patrimônio Líquido e Cotas

Evolução Patrimonial (R\$ milhões)



Fechamento de Mês (R\$ - Mil)

Razão de Garantia Sênior
(%PL)Razão de Garantia Mezanino
(%PL)Direito Creditórios
líquido de PDD (%PL)

10,20% 10,00%

5,27% 5,00%

93,28%

50,00%

■ Atual ■ Mínima

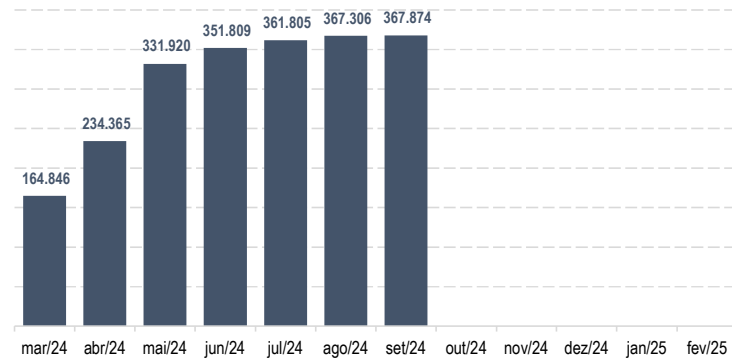
■ Atual ■ Mínima

■ Atual ■ Mínima

Índice de Cobertura Sênior	>=1	1,008 Enquadrado
Índice de Cobertura Mezanino	>=1	1,004 Enquadrado
Índice de Resolução de Cessão	<=1%	0,00% Enquadrado
Índice de Pré-Pagamento	<=3%	0,02% Enquadrado
Índice de Atraso	<=10%	0,01% Enquadrado
Índice de Arrecadação	>=93%	100,00% Enquadrado



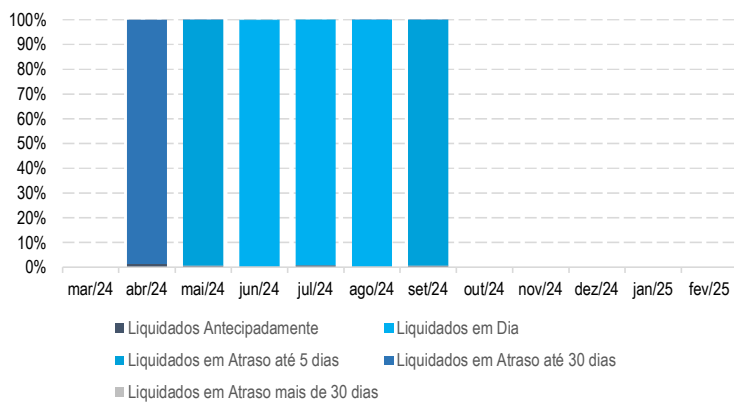
Quantidade de Devedores



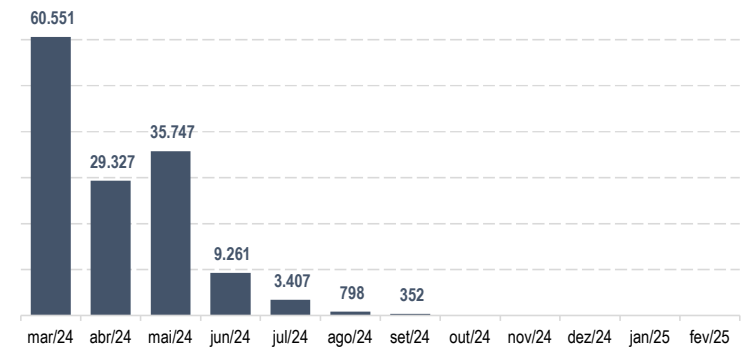
Prazo Médio da Carteira (Meses)



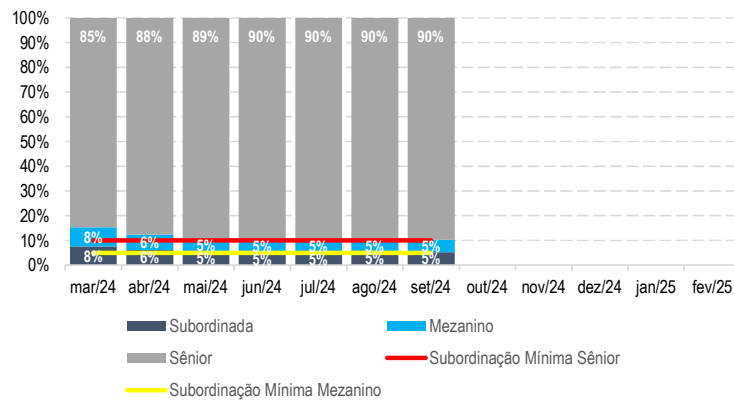
Comportamento das Liquidações dos Títulos (R\$ mil)



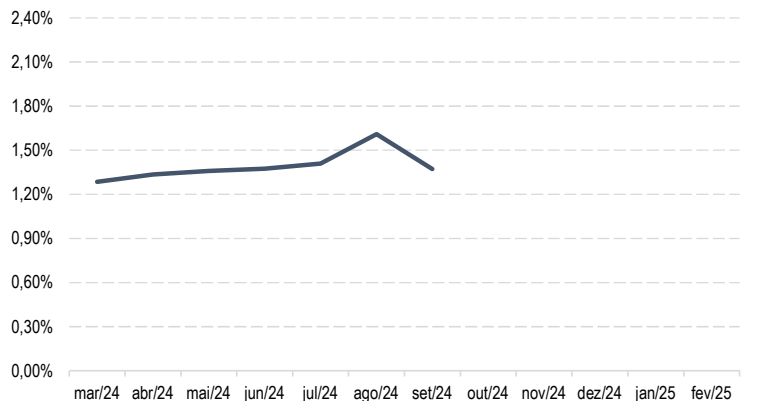
Volume Operado Mensal (R\$ mil)



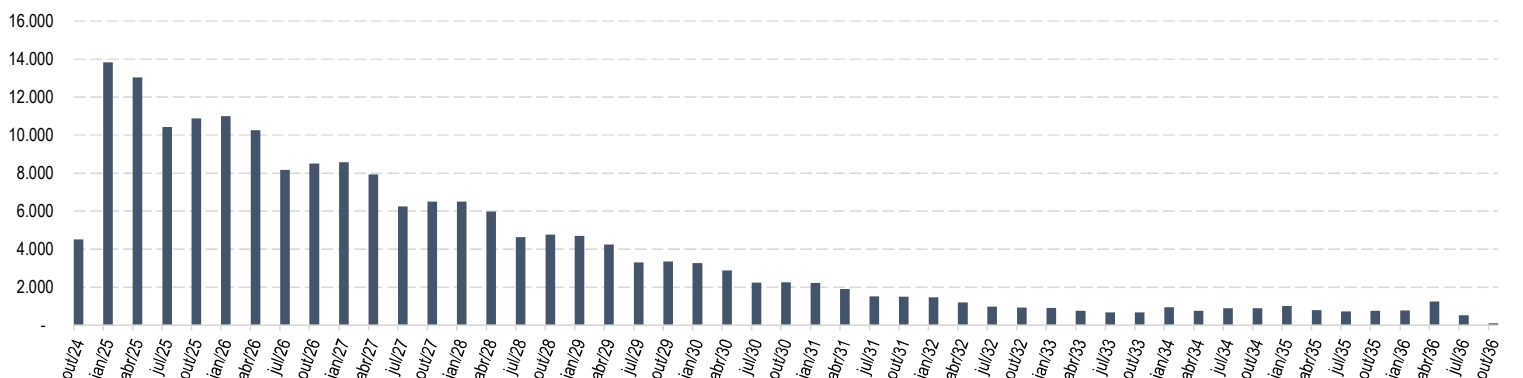
Distribuição de Passivo



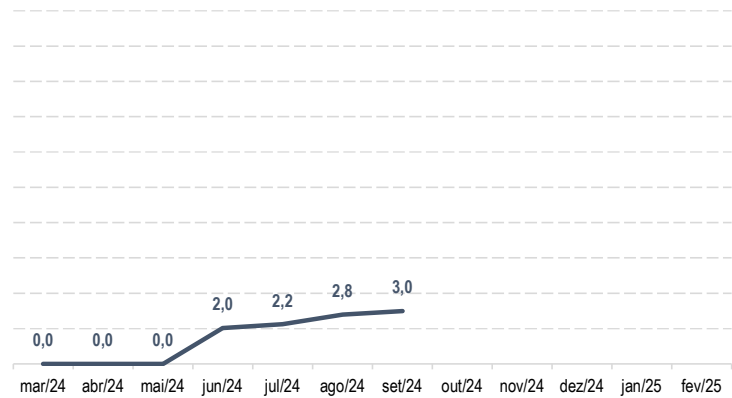
Taxa Média Aquisição (a.m.)*



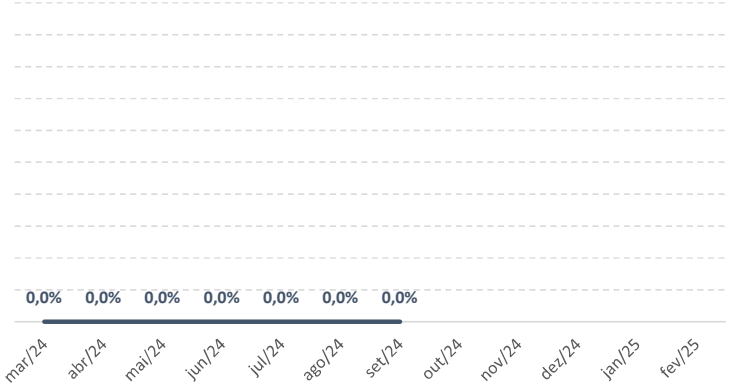
Cronograma de Vencimentos (Acumulado Trimestralmente) - R\$ mil



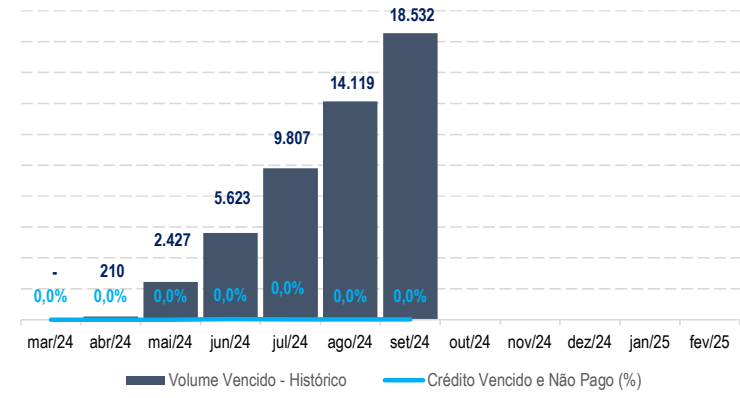
Crédito Vencido e Não Pago Acumulado (R\$ mil)



PDD x Direito Creditório



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



PDD x Patrimônio Líquido - R\$ mil

