

Início do fundo: 14/06/2023

PRESTADORES

Gestora: Struttura Capital
Consultoria: Ceres Investimentos
Administrador e Custodiante: Oliveira Trust

OBJETIVO

O Fundo tem por objetivo a captação de recursos para a aquisição de Direitos Creditórios que atendam aos Critérios de Elegibilidade estabelecidos no Regulamento, com ou sem coobrigação dos respectivos Cedentes, nos termos da política de investimento descrita no Regulamento.

PERFORMANCE MENSAL

		Jun/23	Jul/23	Ago/23	Set/23	Out/23	Nov/23	Dez/23	Jan/24	Fev/24	Mar/24	Acum
Sr.	Rent. %	0,85%	1,63%	1,79%	1,55%	1,56%	0,67%	-	-	-	-	8,03%
	%CDI	139%	152%	157%	159%	156%	162%	-	-	-	-	149%
Mez.	Rent. %	0,98%	1,86%	2,04%	1,77%	1,79%	0,77%	-	-	-	-	9,18%
	%CDI	160%	174%	179%	182%	179%	186%	-	-	-	-	171%
Jr.	Rent. %	-2,61%	-6,39%	-15,73%	0,96%	2,15%	2,52%	-	-	-	-	-16,5%
	%CDI	-427%	-597%	-1378%	98%	216%	609%	-	-	-	-	-307%

RENTABILIDADE ACUMULADA

		2023	2024	3M	6M	12M
Sênior A brA(sf)(p)	Rent	8,03%	-	4,77%	8,03%	8,03%
	CDI	149%	-	158%	149%	149%
Mezanino A brBB(sf)(p)	Rent	9,18%	-	5,46%	9,18%	9,18%
	CDI	171%	-	181%	171%	171%
Júnior brB(sf)(p)	Rent	-17%	-	-9,10%	-17%	-17%
	CDI	-307%	-	-302%	-307%	-307%

DISTRIBUIÇÃO DE COTAS

TIPO	Benchmark	Nº Cotas	PL (R\$)	%PL
Sênior	CDI+7% a.a.	41.560	42.112.963	49%
Mezanino	CDI+10% a.a.	33.250	33.759.009	39%
Júnior	-	12634,74	10.287.810	12%
TOTAL			86.159.782	100%

ÍNDICES DE ACOMPANHAMENTO

ALOCAÇÃO MÍNIMA	80%	≥ 50%	ÍNDICE DE COBERTURA	1,11	≥ 1,00
RESERVA AMORTIZAÇÃO	R\$ 1.191.333		ÍNDICE DE LIQUIDEZ	1,36	≥ 1,00
RESERVA DE ENCARGOS	R\$ 176.535		ÍNDICE DE INAD. 60	0%	≤ 10%
CAIXA DISPONÍVEL	R\$ 12.732.359		ÍNDICE DE INAD. 90	0%	≤ 3%
ÍNDICE DE SUB. MEZ	12%	≥ 10%	ÍNDICE DE SUBSTITUIÇÃO	0%	≤ 5%
ÍNDICE DE SUB. SR.	51%	≥ 50%	ÍNDICE DE RENEGOCIAÇÃO	0%	≤ 2%
PARTES RELACIONADAS SUB.	100%	≥ 50%	ÍNDICE DE PRÉ-PAGAMENTO	0%	

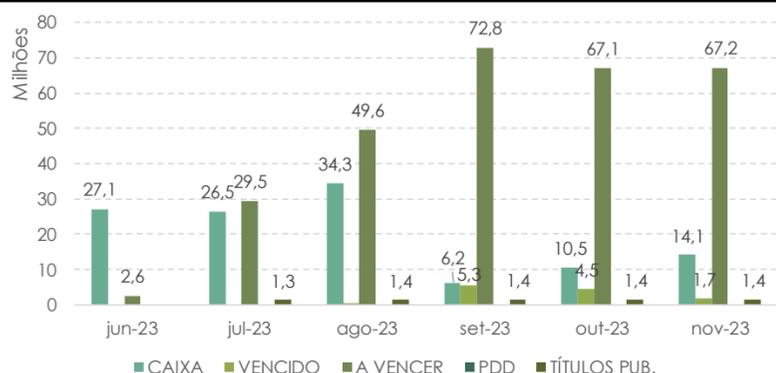
ÍNDICES DE ACOMPANHAMENTO

DIREITOS CREDITÓRIOS	80%	R\$68.938.210	TÍTULOS NO FUNDO	1.554
DC A VENCER	97,5%	R\$67.211.483	SACADOS NO FUNDO	447
DC VENCIDOS	2,5%	R\$1.726.727	CEDENTES NO FUNDO	34
DC C/ COBRIGAÇÃO		99%	PRAZO MÉDIO	223
DC S/ COBRIGAÇÃO		1%	TAXA MÉDIA CARTEIRA A.M.	2,19%
PDD (R\$)		0,00	TAXA MÉDIA CARTEIRA A.A.	29,71%
PDD (%DC)		0%	TICKET MÉDIO	R\$ 49.215
PDD (%PL)		0%	CONTROLE (IN RFB Nº 1585)	503

Início do fundo: 14/06/2023

CEDENTES	Jul/23	Ago/23	Set/23	Out/23	Nov/23
PRAZO MÉDIO	125	196	190	214	203
TAXA MÉDIA	2,22%	2,21%	2,18%	2,20%	2,19%
TICKET MÉDIO	R\$ 50.797	R\$ 41.608	R\$ 47.573	R\$ 50.045	R\$ 49.215

EVOLUÇÃO DO ATIVO



EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO



CONCENTRAÇÃO CEDENTES E SACADOS

CEDENTES	VP (R\$)	%PL	ACUMULATIVO %
1	7.589.952	9%	9%
2	6.535.104	8%	16%
3	5.810.288	7%	23%
4	4.877.199	6%	29%
5	3.785.312	4%	33%
6	3.588.252	4%	37%
7	3.376.549	4%	41%
8	3.334.424	4%	45%
9	3.302.159	4%	49%
10	3.126.301	4%	53%
OUTROS	23.612.669	27%	80%

SACADOS	VP (R\$)	%PL	ACUMULATIVO %
1	3.785.312	4%	4%
2	3.376.549	4%	8%
3	3.334.424	4%	12%
4	3.083.516	4%	16%
5	2.364.938	3%	19%
6	2.091.198	2%	21%
7	1.982.591	2%	23%
8	1.667.134	2%	25%
9	1.631.847	2%	27%
10	1.624.275	2%	29%
OUTROS	43.996.425	51%	80%

HISTÓRICO CONCENTRAÇÃO CEDENTES

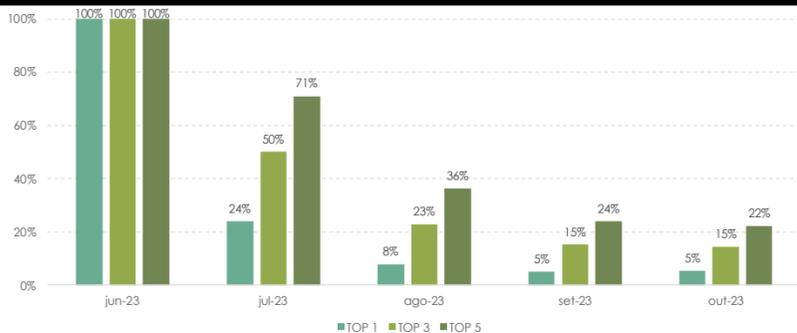


HISTÓRICO CONCENTRAÇÃO SACADOS

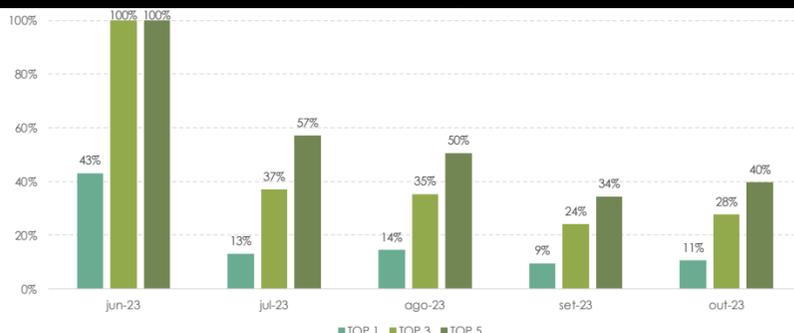


Início do fundo: 14/06/2023

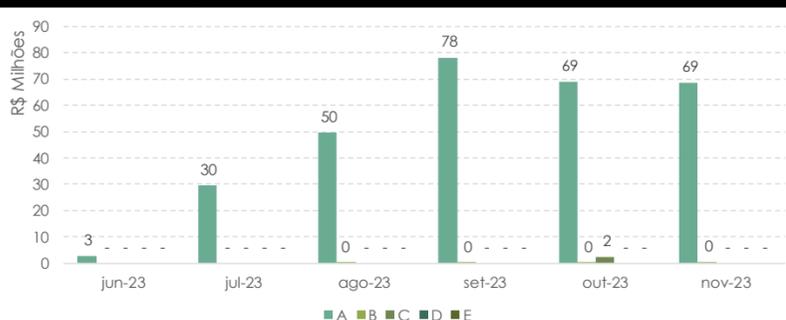
HISTÓRICO CONCENTRAÇÃO TOP CEDENTES



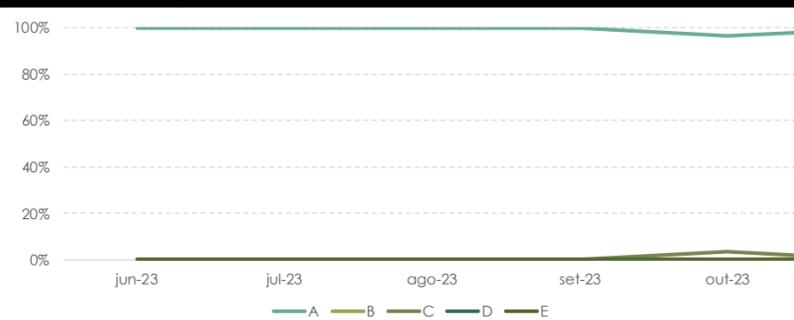
HISTÓRICO CONCENTRAÇÃO TOP SACADOS



EVOLUÇÃO DC POR FAIXA DE ATRASO

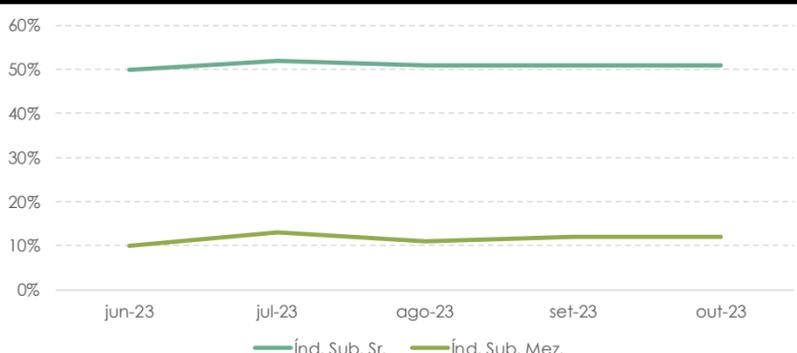


EVOLUÇÃO DC POR FAIXA DE ATRASO (%)

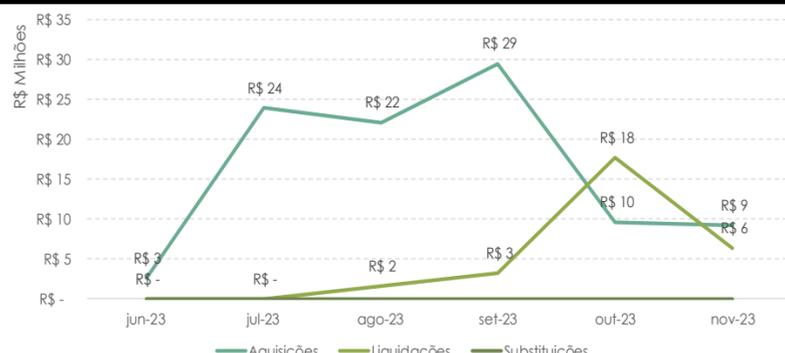


* A = a vencer à 15 atraso / B = +15 à 30 / C = +30 à 60 / D = +60 à 90 / E = +90

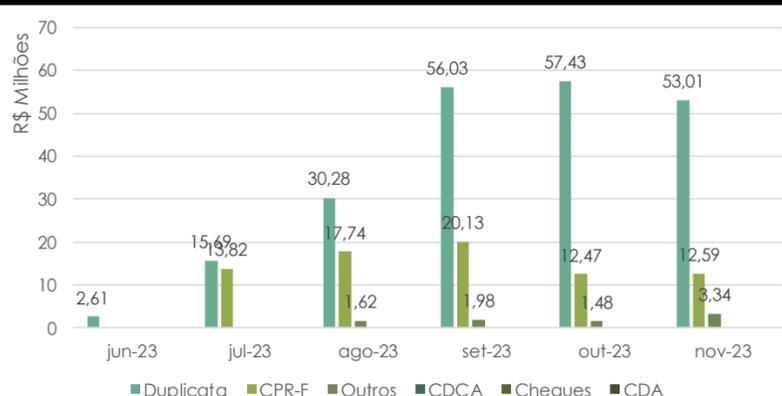
EVOLUÇÃO ÍNDICE DE SUBORDINAÇÃO



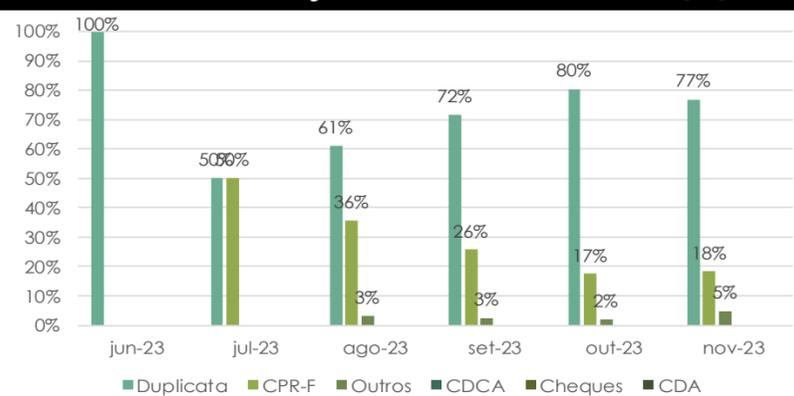
EVOLUÇÃO MOVIMENTAÇÕES DC



CONCENTRAÇÃO POR TIPO DE DC



CONCENTRAÇÃO POR TIPO DE DC (%)



CONCENTRAÇÃO POR REGIÃO DO DC

