DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL

MARSSANI FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS NÃO PADRONIZADOS

CNPJ: 53.174.018/0001-76

4º Trimestre de 2023

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA	VALORES	% PL
DEBENTURES	124.067.051,23	21,088070476
DIREITOS CREDITÓRIOS	498.933.153,18	84,805251618
DISPONIBILIDADES	1.489.014,00	0,253092436
CONTAS A PAGAR	-36.161.085,82	-6,146414529
CONTAS A RECEBER	0,00	0,000000000
PATRIMÔNIO LÍQUIDO	588.328.132,59	100,00000000

1. **Análise de resultado e aderência à política de investimentos e limites de composição estabelecidos em Regulamento.**

   Carteira enquadrada em relação aos limites de composição e diversificação de portfólio estabelecidos no Regulamento e na Instrução CVM nº 356/01, conforme alterada.

2. **Taxas utilizadas nas operações**

   Os ativos integrantes da carteira são precificados conforme a sua curva de aquisição. Os demais ativos da carteira são precificados de acordo com o manual de precificação do Administrador.

3. **Os procedimentos de verificação de lastro por amostragem adotada pelo Custodiante. Metodologia para aplicação da verificação:**

   Informamos que o processo de auditoria de lastro pressupõe a cooperação entre os prestadores de serviço do Fundo, principalmente entre o custodiante e o gestor, de forma proporcionar as informações e documentos necessários para adequada análise do auditor de lastro contratado pelo custodiante.

   Nesse sentido, informamos que atualmente foi contratado pelo custodiante auditoria que se encontra em curso, e necessita de informações adicionais a serem prestadas pelo gestor, as quais já estão sendo fornecidas. Isso porque o Fundo investe em operações estruturadas, cuja complexidade demanda participação ativa do gestor na demonstração de sua tese de investimento, bem como do arcabouço documental que compõem o lastro de referidas operações.

Atenciosamente.

ÍNDIGO INVESTIMENTOS DTVM LTDA.