DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL
Relatório Trimestral – 28 de junho de 2024

À Comissão de Valores Mobiliários - CVM

Prezados senhores,

O Banco Daycoval S.A. ("Administrador"), CNPJ 62.232.889/0001-90, na qualidade de administrador do **SC FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS RESPONSABILIDADE ILIMITADA - CNPJ nº 53.429.996/0001-11** ("Fundo"), disciplinado pela Resolução CMN 2.907, pela Instrução CVM 175 e alterações posteriores, apresenta as informações relativas ao **2º Trimestre de 2024:**

1. OBJETIVO DO FUNDO E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A Classe 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 da Classe.

As informações sobre a Política de Investimentos estão relacionadas no Capítulo 6 do Regulamento do Fundo.

2. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

As operações praticadas pelo Fundo no período estiveram em consonância com a política de investimento prevista em seu regulamento e com os limites de composição e de diversificação a ele aplicáveis.

- Composição da carteira na data base (28/06/2024):

Carteira	Valores	% PL
Caixa	R$ 0,00	0,0%
Valores Mobiliários	R$ 58.198,04	0,1%
PDD Valores Mobiliários	R$ 0,00	0,0%
Contas a Receber	R$ 8.706,93	0,0%
Contas a Pagar	-R$ 93.127,87	-0,1%
Cotas de FIDC	R$ 0,00	0,0%
PDD Cotas de FIDC	R$ 0,00	0,0%
Direitos Creditórios		
-Recebiveis a vencer	R$ 108.905.179,28	99,9%
-Recebiveis vencidos	R$ 120.000,00	0,1%
PDD	R$ 0,00	0,0%
PL	**R$ 108.998.956,38**	**100,0%**

3. DAS COTAS

SC FIDC - SUBORDINADA			
	abril	**maio**	**junho**
Valor Cota	1.013,79	1.031,42	1.047,80
PL	60.266.693,03	107.303.098,96	108.999.113,39
Benchmark	Não Aplicável	Não Aplicável	Não Aplicável
Rating	Não Aplicável	Não Aplicável	Não Aplicável

4. DA AQUISIÇÃO DE DIREITOS CREDITÓRIOS PELO FUNDO

Durante o trimestre em referência, o Fundo realizou a aquisição de Direitos Creditórios em consonância às regras, condições e procedimentos estabelecidos pela legislação vigente e pelo Regulamento do Fundo.

AQUISIÇÕES DE DIREITOS CREDITÓRIOS		
Mês	**Valor de Aquisição**	**Qnt de Títulos**
abril	57.800.000,00	27
maio	45.600.000,00	9
junho	0,00	0

5. DA NATUREZA DOS DIREITOS CREDITÓRIOS ELEGÍVEIS AO FUNDO

As informações sobre a natureza dos direitos creditórios a serem adquiridos e dos instrumentos jurídicos, contratos ou outros documentos representativos do crédito estão relacionadas no Capítulo 8 do Regulamento do Fundo.

6. DOS EVENTOS DE PRÉ PAGAMENTO DE DIREITOS CREDITÓRIOS

Não houve evento de pré-pagamento dos Direitos Creditórios durante o trimestre em referência.

7. DAS ALIENAÇÕES DE DIREITOS CREDITÓRIOS

No trimestre analisado, o Fundo não alienou direitos creditórios.

8. DAS GARANTIAS

As informações sobre as garantias estão descritas no Regulamento do Fundo.

9. DA POLÍTICA DE CONCESSÃO DE CRÉDITO DOS ORIGINADORES DOS RECEBÍVEIS

As informações sobre a Política de Concessão de Crédito estão descritas no Regulamento do Fundo.

10. CONCENTRAÇÃO DO(S) MAIORES CEDENTE(S) EM RELAÇÃO A CARTEIRA

No período analisado, não houve concentração de cedente maior que 20% do Patrimônio Líquido do Fundo.

11. DA POLÍTICA DE COBRANÇA DOS DIREITOS CREDITÓRIOS

As informações sobre os mecanismos e procedimentos de cobrança dos direitos creditórios estão descritas no Regulamento do Fundo.

12. PROCEDIMENTO DE VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS DIREITOS CREDITÓRIOS

A verificação de lastro dos Direitos Creditórios será realizada por amostragem e realizada pela Gestora ou empresa sub contratada devendo ser utilizados os seguintes procedimentos e parâmetros em relação à quantidade de Direitos Creditórios endossados, sem prejuízo da faculdade de contratar auditor específico para tal verificação, conforme abaixo:

Procedimentos: Obtenção de base de dados analítica por recebível junto ao Custodiante, ou empresa terceira de guarda contratada, para seleção de uma amostra de itens para fins de verificação dos Documentos Representativos do Crédito.

Seleção de uma amostra aleatória de itens a serem verificados. A seleção dos Direitos Creditórios será obtida de forma aleatória: (a) o tamanho da amostra (n) será obtido segundo a metodologia abaixo; (b) sorteia-se um ponto de partida; e (c) a cada K elementos, será retirada uma amostra.

Será selecionada uma amostra utilizando as bases de dados (i) e (ii) unificadas, obedecendo os seguintes critérios:
Tamanho da amostra:
O tamanho da amostra será definido por meio da aplicação da seguinte
fórmula matemática e seguintes parâmetros estatísticos:

$$\boldsymbol{n} = \frac{\boldsymbol{N} * \boldsymbol{z}^{\boldsymbol{2}} * \boldsymbol{p} * (\boldsymbol{1} - \boldsymbol{p})}{\boldsymbol{ME}^{\boldsymbol{2}} * (\boldsymbol{N} - \boldsymbol{1}) + \boldsymbol{z}^{\boldsymbol{2}} * \boldsymbol{p} * (\boldsymbol{1} - \boldsymbol{p})}$$

Onde:
n = tamanho da amostra
N = totalidade de Direitos Creditórios endossados
Z = Critical Score = 1,96
p = proporção a ser estimada = 50%
ME = erro aceitável = 5,8%O Custodiante efetuará, diretamente ou por terceiro, a verificação da totalidade do lastro dos Direitos Creditórios até a Data de Aquisição.

Foi utilizada a data base de 31/05/2024.

12.1 DOS RESULTADOS APRESENTADOS

i) Direitos Creditórios a Vencer:

Documentos representativos do lastro:	Analisados	Inconsistências	% Carteira	% PL
Nota Comercial	37	-	-	-

ii) Direitos Creditórios Vencidos:

Documentos representativos do lastro:	Analisados	Inconsistências	% Carteira	% PL
Nota Comercial	1	-	-	-

iii) Direitos Creditórios Substituídos:

O Fundo não possui direitos creditórios substituídos no trimestre.

12.2 DOS REGISTROS DE DIREITOS CREDITÓRIOS

i) Direitos Creditórios Registrados:

Direito Creditório	Registrados	% Carteira	% PL
-	-	-	-

i) Direitos Creditórios Não Registrados:

Direito Creditório	Não Registrados	% Carteira	% PL
-	-	-	-

13. AÇÕES JUDICIAIS, PROCESSOS ADMINISTRATIVOS OU ARBITRAIS

Durante o trimestre em referência, não houve ações judiciais, processos administrativos ou arbitrais.

14. DESCRIÇÃO DE CONTRATOS RELEVANTES FIRMADOS NA CESSÃO DOS DIREITOS CREDITÓRIOS AO FUNDOS

Toda e qualquer operação realizada pelo Fundo deve estar em consonância com os termos estabelecidos no Contrato de Cessão, celebrado, individualmente, com cada um dos cedentes. Adicionalmente, cada uma das cessões de direitos de crédito deve ser formalizada através de Termo de Cessão.

15. IMPACTO NO VALOR DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO E NA RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Em uma eventual descontinuidade nas operações de alienação de direitos creditórios integrantes da carteira do Fundo, os recebíveis seriam levados até a respectiva data de vencimento e precificados conforme metodologia estabelecida, podendo, inclusive, acarretar redução da rentabilidade e, até mesmo, incorrer em perdas, no caso de inadimplência.

16. POSSÍVEL DESCONTINUIDADE NAS OPERAÇÕES DE ALIENAÇÃO DE DIREITOS CREDITÓRIOS REALIZADAS.

Não houve impacto decorrente de descontinuidade das alienações descritas no Item 14.

17. INFORMAÇÕES SOBRE FATOS OCORRIDOS QUE AFETARAM A REGULARIDADE DOS FLUXOS DE PAGAMENTOS PREVISTOS

No período analisado, não houve ocorrências que afetaram a regularidade dos fluxos de pagamentos previstos.

Atenciosamente,

BANCO DAYCOVAL S.A.
CNPJ 62.232.889/0001-90
Administrador do Fundo

DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL

SC - FUNDO DE INVESTIMENTO DIREITOS CREDITÓRIOS RESPONSABILIDADE ILIMITADA

53.429.996/0001-11

2º TRIMESTRE DE 2024

	R$	%PL
Operações de Crédito	R$ 109.025.179,28	100,02%
Cotas de Fundos	R$ 58.198,04	0,05%
Disponibilidades	R$0,00	0,00%
Compromissadas	R$0,00	0,00%
Títulos Públicos	R$0,00	0,00%
Títulos Privados	R$0,00	0,00%
Derivativos	R$ 0,00	0,00%
PDD	R$0,00	0,00%
Valores a Receber / Pagar	R$93.127,87	0,09%
PL	R$108.998.956,38	100,00%
PL - Bruto	R$108.998.956,38	100,00%
Receitas	R$0,00	0,00%
Despesas	R$0,00	0,00%

Clicksign 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95

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

Durante o período analisado, o Fundo apresentou uma performance dentro das expectativas, mantendo sua carteira enquadrada em relação aos limites de composição e diversificação de portfólio estabelecidos no Regulamento e na Resolução CVM nº 175/22, conforme alterada.

2 - Taxas utilizadas nas operações.

A taxa mensal de deságio utilizada nas operações é de 1,77%.

3 - Os procedimentos de verificação de lastro por amostragem adotados pela Gestora.

Conforme estabelece a Resolução CVM 175/2022, a Gestora adota metodologia para realização da verificação de lastro dos direitos creditórios integrantes da carteira do Fundo. Ressalta-se que, conforme prerrogativa da referida Instrução, em fundos em que haja significativa quantidade de créditos cedidos e expressiva diversificação de devedores, a Gestora poderá realizar a verificação do lastro dos direitos creditórios por amostragem. Independentemente da realização de verificação de lastro de direitos creditórios ser realizada por amostragem ou não, é facultado a Gestora contratar, empresa para a prestação do referido serviço.
A verificação de lastro dos direitos creditórios realizada pela Gestora ou por terceiro contratado ocorre através de criteriosa inspeção dos documentos representativos dos créditos, levando-se em conta as evidências de validade, legalidade, veracidade, formalidade, completude e exequibilidade dos direitos creditórios e, ainda, a forma como se realizaram as cessões para o Fundo.
A verificação do lastro é realizada, reiteradamente: (i) quando da aquisição de todo e qualquer direito creditório pelo Fundo; e (ii) trimestralmente, considerados apenas os direitos creditórios adquiridos pelo Fundo no período compreendido entre a data-base da última verificação e a data base da verificação a ser realizada.
Quando realizada por amostragem, a verificação de lastro trimestral dos direitos creditórios se estabelece através da análise de uma amostra estatisticamente relevante extraída de uma população que compreende somente os direitos creditórios "a vencer" integrantes da carteira do Fundo no trimestre de referência.
A seleção dos direitos creditórios que compõem a amostra será obtida de forma a garantir, estatisticamente, o reflexo da carteira do Fundo, considerando sua estrutura e a natureza dos créditos. Parcela da amostra dos direitos creditórios assume a variável de representatividade de risco, inerente aos principais Cedentes e/ou Devedores dos créditos, sendo complementada por outros créditos selecionados a partir de sorteios realizados em intervalo de retirada, estabelecidos através da razão entre o tamanho da população e o tamanho da própria amostra, de forma a contemplar o critério de aleatoriedade.
Importante frisar que a métrica de seleção não se aplica para os créditos inadimplentes e para os substituídos no período de referência. No caso de existirem direitos creditórios vencidos na data base da verificação a ser realizada ou se o Fundo realizou substituições de créditos no trimestre de referência, o Custodiante deverá proceder com a análise da totalidade do lastro dos referidos direitos creditórios, independentemente da verificação integral do lastro quando da aquisição dos direitos creditórios pelo Fundo, conforme informado anteriormente.
Abaixo, apresentamos os resultados da verificação do lastro, tendo como referência o dia 31/05/2024**,** data em que a população e a amostra foram definidas, de acordo com a fórmula e os critérios de seleção estabelecidos no Regulamento do Fundo.

4 - Resultados da verificação do lastro por amostragem.

Clicksign 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95

	Quantidade	Valor Nominal	Valor Presente
Créditos a vencer na data de verificação	37	R$ 133.959.312,33	R$ 107.189.086,28
Créditos a vencer (analisados)	37	R$ 133.959.312,33	R$ 107.189.086,28
	Quantidade	**Valor Nominal**	**Valor Liquidado**
Créditos vencidos na data de verificação	1	R$ 120.000,00	R$ 120.000,00
Créditos vencidos (analisados)	1	R$ 120.000,00	R$ 120.000,00
	Quantidade	**Valor Nominal**	**Valor Liquidado**
Créditos substituídos no período	0	R$ 0,00	R$ 0,00
Créditos substituídos (analisados)	0	R$ 0,00	R$ 0,00
	Quantidade	**Valor Nominal**	**Valor Aquisição**
Créditos adquiridos no período	38	R$ 134.079.312,33	R$ 105.400.000,00

Para casos em que o Gestor verifique créditos inexistentes, com pendência de lastro ou que apresentaram outras inconsistências que possam incorrer em embaraço à cobrança regular ou judicial, o Administrador adota as seguintes ações, conforme o caso e pela ordem: (i) notificação imediata das ocorrências para o Custodiante, Consultor de Crédito e Agente de Cobrança dos direitos creditórios contratados pelo Fundo a fim de determinarem do respectivo Cedente a liquidação ou substituição dos referidos títulos em até 5 (cinco) dias úteis; (ii) o bloqueio imediato de novas operações do Fundo junto ao respectivo Cedente em quanto persistirem créditos em desconformidade na carteira do Fundo; e (iii) a submissão da situação ao Comitê de Crédito do Administrador para eventual aplicação de provisionamento de valores em face da percepção do risco de crédito das operações.

5.a - A natureza dos direitos creditórios a serem adquiridos e dos instrumentos jurídicos, contratos ou outros documentos representativos do crédito.

Nota comercial.

5.b – Descrição dos mecanismos e procedimentos de cobrança dos direitos creditórios, inclusive inadimplentes, coleta e pagamento/rateio destas despesas entre os membros do condomínio, caso assim seja determinado pelo regulamento do fundo.

O Fundo, por meio do seu representante legal, deverá atuar no polo ativo de qualquer cobrança judicial contra os Devedores e/ou Devedores Solidários dos Direitos de Crédito Inadimplidos.
A contratação dos agentes de cobrança e/ou terceiros qualificados para realização: a) Da cobrança e arrecadação dos pagamentos relativos aos Direitos de Crédito Inadimplidos; b) Cobrança judicial e/ou extrajudicial, não eximirá o Custodiante de suas obrigações de cobrança dos Direitos de Crédito Inadimplidos, conforme previsto na regulamentação em vigor.

6 – Efeitos das alterações apontadas no Item 5 sobre a rentabilidade da carteira.

Não houve inadimplência.

7.a – Critérios para a concessão de crédito adotados pelos originadores que representem, individualmente, 10% ou mais da carteira do fundo no trimestre.

A estratégia do fundo é financiar um grupo empresarial específico embasado pela regulamentação CVM 175 art. 44. Sem limitação de porcentagem máxima para cedentes e sacados. FIDC para investidores profissionais.

7.b – Alterações nos critérios para a concessão de crédito adotados por originadores que representem, individualmente 10% ou mais da carteira do fundo no trimestre.

Não houve alteração no período.

8 – Garantias existentes para o conjunto de ativos.

Não há garantias.

9.a – Descrição de contratos relevantes firmados na cessão dos direitos creditórios ao fundo.

Não teve nenhum sacado com mais 20% de concentração no período.

9.b – Indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão.

Sim, operação com caráter definitivo.

10 – Impacto no valor do patrimônio líquido do fundo e na rentabilidade da carteira dos eventos de pré-pagamento.

Durante o período analisado, o Fundo não apresentou pré-pagamentos de diretos creditórios no valor de R$ 0,00, tendo um impacto de R$ 0,00 na carteira do fundo.

11 – Análise do impacto dos eventos de pré-pagamento descrito no Item 10.

Dada a natureza dos direitos creditórios que integram a carteira do Fundo, assim como seu modelo operacional, o eventual impacto da ocorrência de pré-pagamentos pode ser considerado bastante reduzido, uma vez que o Fundo é caracterizado pelo regime de revolvência.

12 – Condições de alienação, a qualquer título, inclusive por venda ou permuta, de direitos creditórios, incluindo

A qualquer tempo, o Fundo pode alienar a terceiros, e mesmo ao Cedente (recompra), os direitos creditórios integrantes de sua carteira.

Clicksign 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95

13 – Impacto no valor do patrimônio líquido do fundo e na rentabilidade da carteira de uma possível descontinuidade nas operações de alienação de direitos creditórios realizadas.

Em uma eventual descontinuidade nas operações de alienação de direitos creditórios integrantes da carteira do Fundo, os recebíveis seriam levados até a respectiva data de vencimento e precificados conforme metodologia estabelecida, podendo, inclusive, acarretar redução da rentabilidade e, até mesmo, incorrer em perdas, no caso de inadimplência.

14 – Análise do impacto da descontinuidade das alienações descrito Item 13.

Durante o período analisado, o Fundo não apresentou descontinuidade de operações em alienação diretos creditórios no valor de R$ 0,00, tendo um impacto de R$ 0,00 na carteira do fundo.

15 – Eventos previstos nos contratos firmados para estruturar a operação que acarretara a amortização antecipada dos direitos creditórios cedidos ao Fundo.

Não ocorreram eventos.

16 – Informações sobre fatos ocorridos que afetaram a regularidade dos fluxos de pagamento previstos.

Não ocorreram eventos.

Atenciosamente,

Catálise Investimentos LTDA.

Clicksign 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95

Rua Dr. Manoel Pedro, 365 – 3° Andar - Cabral Curitiba/PR - CEP 80035-030 | Tel (+55 41) 3014-8444 |
ouvidoria@cataliseinvestimentos.com | cataliseinvestimentos.com

Clicksign 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95

Demonstrativo Trimestral 2ºT24 - SC (final).pdf

Documento número #2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95

Hash do documento original (SHA256): 871f0c87439e831d7e61da08e6a64b19240e9523d2c2cd03f71b66c38204a3b8

Assinaturas

Bruno Lopresti Lage
Assinou como gestor em 13 ago 2024 às 17:34:06

Log

13 ago 2024, 17:22:07	Operador com email martins@cataliseinvestimentos.com na Conta 8ab15086-199f-4084-a348-3a4b53b2287a criou este documento número 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95. Data limite para assinatura do documento: 12 de setembro de 2024 (17:22). Finalização automática após a última assinatura: habilitada. Idioma: Português brasileiro.
13 ago 2024, 17:26:38	Operador com email martins@cataliseinvestimentos.com na Conta 8ab15086-199f-4084-a348-3a4b53b2287a adicionou à Lista de Assinatura: lage@cataliseinvestimentos.com para assinar como gestor, via E-mail, com os pontos de autenticação: Token via E-mail; Nome Completo; endereço de IP. Dados informados pelo Operador para validação do signatário: nome completo Bruno Lopresti Lage.
13 ago 2024, 17:34:06	Bruno Lopresti Lage assinou como gestor. Pontos de autenticação: Token via E-mail lage@cataliseinvestimentos.com. IP: 177.26.249.65. Componente de assinatura versão 1.949.0 disponibilizado em https://app.clicksign.com.
13 ago 2024, 17:34:07	Processo de assinatura finalizado automaticamente. Motivo: finalização automática após a última assinatura habilitada. Processo de assinatura concluído para o documento número 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95.

Documento assinado com validade jurídica.
Para conferir a validade, acesse https://www.clicksign.com/validador e utilize a senha gerada pelos signatários ou envie este arquivo em PDF.
As assinaturas digitais e eletrônicas têm validade jurídica prevista na Medida Provisória nº. 2200-2 / 2001

Este Log é exclusivo e deve ser considerado parte do documento nº 2f26d686-68e2-41bb-bf4f-68fbaf14fa95, com os efeitos prescritos nos Termos de Uso da Clicksign, disponível em www.clicksign.com.