FINVEST
DTVM

Demonstrativo Trimestral – 3º Trimestre/2024

VLTZ I FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS NÃO PADRONIZADO

43.143.355/0001-42

Política de Investimento

I – Que as operações praticadas pelo fundo estão em consonância com a política de investimento prevista em seu regulamento e com os limites de composição e de diversificação a ele aplicáveis;

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.

Mês Escrito	PL	Direitos Creditórios	% Relação
Julho de 2024	23.052.224,04	35.964.950,89	156,02%
Agosto de 2024	24.241.810,98	34.852.120,75	143,77%
Setembro de 2024	24.957.816,10	33.336.104,47	133,57%

Composição da Carteira - Fechamento de Setembro de 2024		
Alocações	**Valor (R$)**	**Relação PL (%)**
Disponibilidades	-	0,00%
Renda Fixa	138.054,59	0,32%
Cotas de Fundos	-	
Renda Fixa	8.301.958,48	19,54%
Outros Fundos	-	0,00%
Direitos Creditórios		
A Vencer	28.651.129,32	67,42%
Vencidos	46.324.314,21	109,02%
Provisão para Devedores Duvidosos	- 41.639.339,06	-97,99%
Outros Valores e Bens		
Contas a Pagar e Receber		
Contas a Pagar	- 52.485,55	-0,12%
Contas a Receber	769.850,48	1,81%
Patrimônio Líquido	42.493.482,47	100

Cota Subordinada	Valor de Cota	Rentabilidade
Julho de 2024	102,02	0,04%
Agosto de 2024	107,28	0,05%
Setembro de 2024	110,45	0,03%

Taxas

II – Que as negociações foram realizadas a taxa de mercado;

As taxas oscilam de operação para operação, dificultando a sinalização de uma taxa de referência. Os ativos da carteira são precificados de acordo com o manual de precificação do Administrador.

Verificação de Lastro

III – Os procedimentos de verificação de lastro por amostragem adotados pelo custodiante, incluindo a metodologia para seleção da amostra verificada no período, se for o caso;

Conforme previsto no Regulamento do Fundo, a verificação de lastro dos direitos creditórios será realizada por amostragem, nos termos do § 1º, do artigo 38, da Instrução CVM nº 356/01.

IV – Os resultados da verificação do lastro por amostragem ou não, realizada pelo custodiante, explicitando, dentre o universo analisado, a quantidade e a relevância dos créditos inexistentes porventura encontrados;

a) quantidade de créditos a vencer analisados;

Não foi encontrado inconsistências na base analisada a vencer.

b) verificação da totalidade de vencidos e substituídos na carteira do fundo, no referido trimestre;

Não foram identificadas quaisquer inconsistências

Direitos Creditórios

V – As informações solicitadas no art. 24, inciso X, alíneas "a", e "c", caso tais informações:

a) a natureza dos direitos creditórios a serem adquiridos e dos instrumentos jurídicos, contratos ou outros documentos representativos do crédito;

A natureza dos direitos creditórios a serem adquiridos e seus respectivos instrumentos jurídicos encontram-se descritos no Regulamento do Fundo. Adicionalmente, informamos que não houve alteração no período em referência.

b) descrição dos processos de origem dos direitos creditórios e das políticas de concessão dos correspondentes créditos;

A descrição do processo de origem dos direitos creditórios e das políticas de concessão dos respectivos créditos encontram-se descritos no Regulamento do Fundo. Adicionalmente, informamos que não houve alteração no período em referência.

VI – Possíveis efeitos das alterações apontadas no inciso V sobre a rentabilidade da carteira;

Não ocorreram alterações para os temas relacionados no item V.

VII – Em relação aos originadores que representem individualmente 10% (dez por cento) ou mais da carteira do fundo no trimestre.

a) eventuais alterações nos critérios para a concessão de crédito adotadas por tais originadores, caso os critérios adotados já tenham sido descritos no regulamento ou em outros demonstrativos trimestrais;

Não ocorreram alterações nos critérios para a concessão de crédito.

b) critérios para a concessão de crédito adotados pelos originadores, caso tais critérios não tenham sido descritos no regulamento ou em outros demonstrativos trimestrais;

Não ocorreram alterações nos critérios para a concessão de crédito

VIII – Eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de ativos.

Não ocorreram alterações nas garantias existentes para o conjunto de ativos.

IX – Forma como se operou a cessão dos direitos creditórios ao fundo, incluindo:

a) Descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito, se houver; e

b) *indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão*.

As cessões de direitos creditórios ocorreram todas de forma definitiva, de acordo com o disposto no regulamento e nos modelos de contrato de cessão

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

Não se aplica

XI – análise do impacto dos eventos de pré-pagamento descrito no inciso X;

Não se aplica

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

a) momento da alienação (antes ou depois do vencimento);

Não ocorreram alienação de ativos da carteira do Fundo.

b) motivação da alienação;

Não ocorreram alienação de ativos da carteira do Fundo.

XIII – Impacto no valor do patrimônio líquido do fundo e na rentabilidade da carteira de uma possível descontinuidade nas operações de alienação de direitos realizados;

***a) pelo cedente; ou a eles ligadas*:**

Não há.

b) por instituições que, direta ou indiretamente, prestam serviços para o fundo;

Não há.

c) por pessoas a eles ligadas

Não há.

XIV - Análise do Impacto da descontinuidade das alienações descrito no inciso XIII;

Não ocorreram alienações de ativos da carteira do Fundo.

XV – Quaisquer eventos previstos nos contratos firmados para estruturar a operação que acarretaram a amortização antecipada dos direitos creditórios cedidos ao fundo.

Não ocorreram eventos que acarretaram a amortização antecipada dos direitos creditórios cedidos ao fundo.

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

Não ocorreram fatos que afetaram a regularidade dos fluxos de pagamento previstos.