

FIDC NEON

Relatório Diário




Fechamento	Últimos 6 dias úteis					
	25/01/2024	26/01/2024	29/01/2024	30/01/2024	31/01/2024	01/02/2024
Patrimônio do fundo	1.939.156.756,39	1.940.167.414,53	1.941.086.920,95	1.942.282.630,17	1.943.450.577,95	1.944.519.876,65
Ativos	2.440.743.018,02	2.573.924.766,47	2.588.960.549,48	2.583.981.115,58	2.607.427.709,39	2.534.877.316,15
Direitos creditórios - R\$	2.080.428.714,78	2.279.925.998,32	2.294.166.722,06	2.272.161.758,30	2.295.658.797,56	2.230.334.413,10
Caixas e equivalentes - R\$	262.367.193,90	196.051.658,81	196.846.718,08	213.872.247,94	213.821.802,49	252.501.054,86
Provisões	-501.586.256,22	-633.757.348,68	-647.873.623,51	-641.698.475,79	-663.977.126,37	-590.357.433,93
PDD - R\$	-418.216.265,93	-564.403.956,06	-564.403.956,06	-564.403.956,06	-564.403.956,06	-564.403.956,06
Contas a pagar e receber - R\$	19.120.676,59	-2.561.536,41	-2.437.087,50	-2.480.792,97	20.758.660,06	-2.550.507,72
Valores a identificar - R\$	-97.952.756,87	-97.952.756,87	-97.952.756,87	-97.974.926,83	-97.952.756,87	-52.047.495,72
Liquidação cobrança D+1 - R\$	-4.537.910,01	31.160.900,66	16.920.176,92	23.161.200,07	-22.379.073,50	28.644.525,57
Valor agregado das provisões e perdas relativas aos Ativos Financeiros - R\$ Mil	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Passivos						
Sênior 1 - Rentabilidade Alvo: CDI + 5.25%						
Patrimônio da cota - R\$	284.219.591,51	284.401.646,12	284.583.816,43	284.766.106,41	284.948.512,08	285.131.033,43
Valor da cota	0,71	0,71	0,71	0,71	0,71	0,71
Rentabilidade dia cota - %	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%
Rentabilidade mês cota - %	1,16%	1,22%	1,29%	1,35%	1,42%	0,06%
Rentabilidade mês cota - CDI +	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%	5,25%
Valor Unitário de Referência	0,77	0,77	0,77	0,77	0,77	0,77
Valor Unitário de Referência Corrigido	0,77	0,77	0,77	0,77	0,77	0,77
Valor Unitário de Referência Corrigido Antes da Amortização	0,77	0,77	0,77	0,77	0,77	0,77
Valor Principal de Referência Anterior	0,76	0,76	0,76	0,76	0,76	0,76
Valor Principal de Referência	0,76	0,76	0,76	0,76	0,76	0,76
Sênior 2 - Rentabilidade Alvo: CDI + 4.75%						
Patrimônio da cota - R\$	271.516.341,60	271.685.126,70	271.854.017,10	272.023.012,80	272.192.111,10	272.361.314,70
Valor da cota	1,01	1,01	1,01	1,01	1,01	1,01
Rentabilidade dia cota - %	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%
Rentabilidade mês cota - %	1,12%	1,19%	1,25%	1,31%	1,38%	0,06%
Rentabilidade mês cota - CDI +	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%	4,75%
Valor Unitário de Referência	1,01	1,01	1,01	1,01	1,01	1,02
Valor Unitário de Referência Corrigido	1,01	1,01	1,01	1,01	1,01	1,02
Valor Unitário de Referência Corrigido Antes da Amortização	1,01	1,01	1,01	1,01	1,01	1,02
Valor Principal de Referência Anterior	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00
Valor Principal de Referência	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00
Mezanino A - Rentabilidade Alvo: CDI + 7.25%						
Patrimônio da cota - R\$	61.756.751,31	61.800.925,60	61.845.131,80	61.889.369,29	61.933.638,69	61.977.939,38
Valor da cota	1,01	1,01	1,01	1,01	1,01	1,01
Rentabilidade dia cota - %	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%
Rentabilidade mês cota - %	1,30%	1,37%	1,44%	1,51%	1,59%	0,07%
Rentabilidade mês cota - CDI +	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%	7,25%
Valor Unitário de Referência	1,09	1,09	1,09	1,09	1,09	1,09
Valor Unitário de Referência Corrigido	1,09	1,09	1,09	1,09	1,09	1,09
Valor Unitário de Referência Corrigido Antes da Amortização	1,09	1,09	1,09	1,09	1,09	1,09
Valor Principal de Referência Anterior	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00
Valor Principal de Referência	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00
Júnior						
Patrimônio da cota - R\$	1.321.664.071,98	1.322.279.716,11	1.322.803.955,63	1.323.604.141,68	1.324.376.316,08	1.325.049.589,14
Valor da cota	1,14	1,14	1,15	1,15	1,15	1,15
Rentabilidade dia cota - %	0,06%	0,05%	0,04%	0,06%	0,06%	0,05%
Rentabilidade mês cota - %	0,84%	0,89%	0,93%	0,99%	1,05%	0,05%
Rentabilidade mês cota - CDI +	0,72%	0,72%	0,63%	0,81%	0,94%	1,80%
Indicadores básicos						
Saldo de Cessão Ajustado - R\$	1.662.212.448,87	1.715.522.042,28	1.729.762.766,02	1.707.757.802,26	1.731.254.841,52	1.703.758.033,10
Valor Presente Ajustado dos Direitos Creditórios - R\$	1.320.924.605,46	1.746.682.942,94	1.746.682.942,94	1.746.682.942,94	1.746.682.942,94	1.746.682.942,94
Valor das Disponibilidades Comprometidas - R\$	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Valor das Disponibilidades Livres - R\$	260.861.546,37	194.546.011,28	195.341.070,55	212.344.430,45	212.316.154,96	250.995.407,33
Valor das Disponibilidades - R\$	260.861.546,37	194.546.011,28	195.341.070,55	212.344.430,45	212.316.154,96	250.995.407,33
Índice de Cobertura da Cessão	79,47%	101,82%	100,98%	102,28%	100,89%	102,52%

Indicadores básicos							
PDD/PL - %		21,57%	29,09%	29,08%	29,06%	29,04%	29,03%
PDD/DC - %		20,10%	24,76%	24,60%	24,84%	24,59%	25,31%
Caixa e equivalentes/PL - %		18,58%	15,15%	15,19%	16,05%	16,04%	15,66%
Alocação em DC - %	50,00%	85,72%	88,42%	89,11%	87,93%	89,08%	85,67%
Prazo médio fiscal - dias	365	408	422	422	417	417	409
PL médio últimos 3 meses - R\$	500.000,00	1.920.185.174,06	1.921.170.318,09	1.922.160.876,33	1.923.151.726,69	1.924.153.784,94	1.925.155.216,03

Indicadores específicos							
Reserva de Despesas e Encargos - R\$	1.500.000,00	1.500.000,00	1.500.000,00	1.500.000,00	1.500.000,00	1.500.000,00	1.500.000,00
Índice de Cobertura do Fundo	1,00	1,66	1,92	1,92	1,95	1,95	2,02
Índice de Cobertura do Fundo Sênior	1,00	1,66	1,92	1,92	1,95	1,95	2,02
Índice de Cobertura do Fundo Mezanino	1,00	1,92	2,29	2,29	2,32	2,32	2,38
Índice de Pagamentos Mensais	50,00%	98,34%	98,34%	98,34%	98,34%	91,98%	98,34%
Taxa Média Ponderada de Parcelamento Vigente a.m.	2,00%	8,24%	8,24%	8,24%	8,24%	9,29%	9,29%
Taxa Média Ponderada de Rotativo Vigente a.m.	5,00%	18,50%	18,50%	18,50%	18,50%	18,50%	18,50%
CCB com Prazo Superior a 1 Ano	10,00%	7,71%	7,72%	7,99%	8,00%	7,94%	7,95%
Prazo máximo CCB	24	23	23	23	23	23	23
Relação Mínima	105,00%	348,93%	348,90%	348,84%	348,84%	348,83%	348,80%

Indicadores Mensais	Últimos 6 meses					
	08/2023	09/2023	10/2023	11/2023	12/2023	01/2024

Cobertura							
Índice de Cobertura do Fundo		1,57	1,64	1,65	1,78	1,82	1,95
Índice de Cobertura do Fundo Sênior		1,57	1,64	1,65	1,78	1,82	1,95
Índice de Cobertura do Fundo Mezanino		1,87	1,99	2,01	2,12	2,21	2,32

Taxas							
Taxa Mínima de Cessão		18,81%	18,28%	18,28%	17,76%	17,23%	17,23%
Taxa Média Ponderada de Parcelamento Vigente a.m.		7,52%	8,31%	9,18%	8,99%	8,24%	9,29%
Taxa Média Ponderada de Rotativo Vigente a.m.		18,50%	18,50%	18,50%	18,50%	18,50%	18,50%

Recebimento dos direitos creditórios							
Índice de Pagamentos Mensais		94,08%	87,02%	91,67%	86,43%	98,34%	91,98%
Índice de Atraso		14,85%	15,34%	15,73%	17,78%	18,71%	19,22%

Rentabilidade das cotas							
Sênior 1		1,61%	1,39%	1,43%	1,33%	1,31%	1,42%
Sênior 2		1,57%	1,35%	1,39%	1,29%	1,27%	1,38%
Mezanino A		1,79%	1,48%	1,59%	1,48%	1,46%	1,59%
Júnior		1,03%	1,10%	0,97%	0,62%	0,91%	1,05%