

Quadro de Rentabilidade

	Cota	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ANO	ACUM
2022	Subordinada	7,58%	3,13%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	10,95%	-8,69%
	Mezanino	0,96%	0,96%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,93%	6,63%
	Sênior	0,96%	0,96%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,93%	8,08%
	CDI	0,73%	0,76%	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,49%	5,47%
2021	Subordinada	-	-	-	0,00%	-1,18%	1,10%	1,30%	-1,13%	-1,34%	-2,58%	-0,86%	-13,68%	-17,70%	-17,70%
	Mezanino	-	-	-	-0,96%	0,50%	0,54%	0,60%	0,67%	0,67%	0,70%	0,81%	1,02%	4,61%	4,61%
	Sênior	-	-	-	0,42%	0,49%	0,53%	0,59%	0,66%	0,67%	0,70%	0,80%	1,01%	6,04%	6,04%
	CDI	-	-	-	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	0,59%	0,77%	3,92%	3,92%

CNPJ: 37.266.510/0001-15

Objetivo / Política de Investimento

O objetivo do Fundo é proporcionar aos Cotistas a valorização de suas Cotas por meio da aplicação de seu Patrimônio Líquido na aquisição de: (i) Direitos Creditórios, e (ii) Ativos Financeiros, conforme definidos no Regulamento do Fundo

Público Alvo

As Cotas Seniores do Fundo serão subscritas e integralizadas exclusivamente por Investidores Profissionais.

Gestão

Integral Investimentos Ltda.
Endereço: Av. Brig. Faria Lima, 1663, 3º andar, São Paulo, SP
Telefone: (11) 3103-9999
Site: www.integralinvest.com.br

Administração/Custódia

Oliveira Trust DTVM S.A.
Endereço: Av. das Américas, 3434, bloco 7, sala 201, Rio de Janeiro, RJ
Telefone: (21) 3514-0000
Site: www.oliveiratrust.com.br

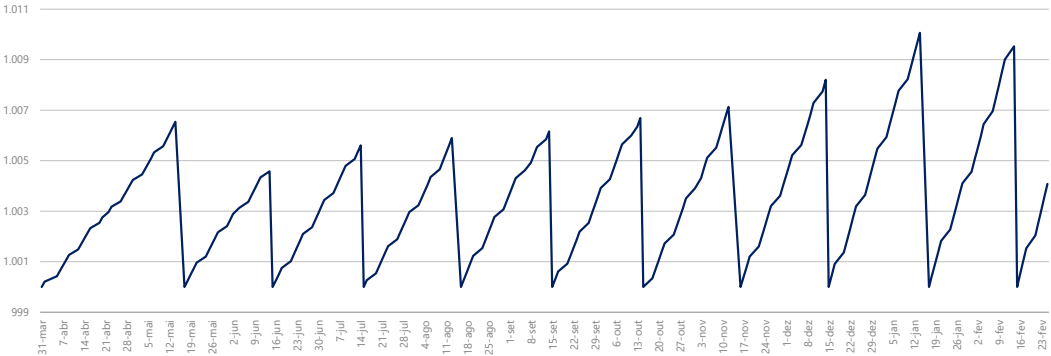
Forma de Condomínio: Fechado

Prazo do Fundo: 20 anos

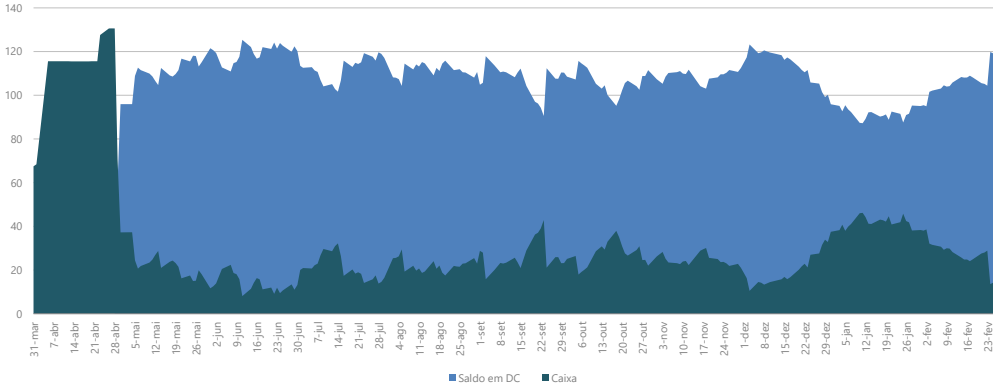
1ª Série Sênior

Início: 31/03/2021
Meta de Remuneração: CDI + 2,75% a.a.
Prazo: 3 anos
PLI inicial: R\$ 1.000,00
Rating: S&P 'AAA(bra)'

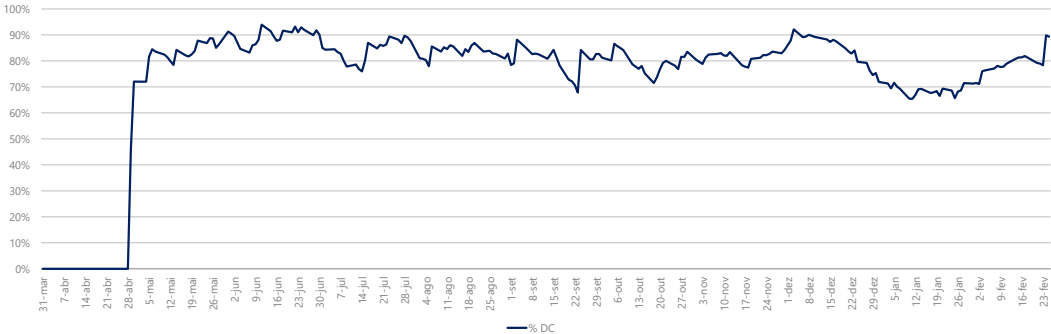
Evolução do PU da Cota Senior (Em R\$ Mil)



Evolução saldo DC x PL (Em R\$ Milhões)



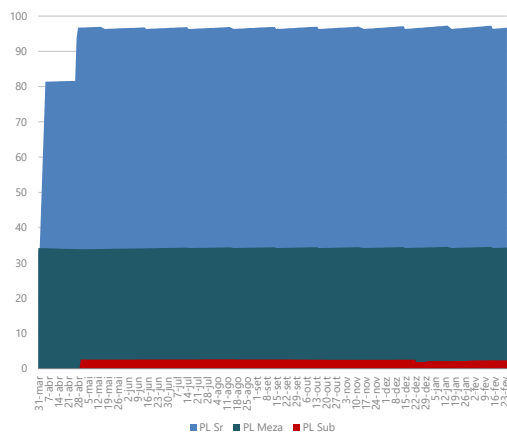
Evolução % DC



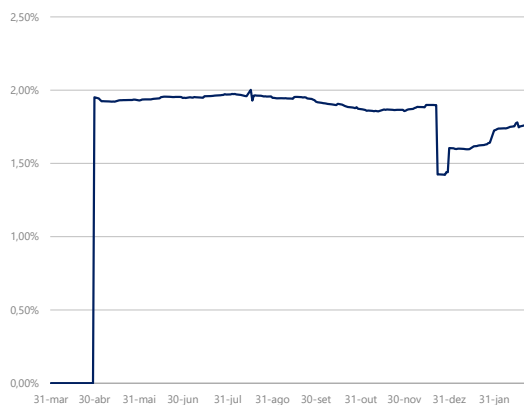
Esta lâmina tem caráter estritamente informativo, e foi preparada pela Integral Investimentos Ltda, exclusivamente para o benefício e uso interno do cotista do Fundo FIDC Calloway não se tratando de oferta de venda de valores mobiliários. A rentabilidade não é líquida de impostos. A existência de uma classe de cotas subordinadas não é garantia que a rentabilidade alvo das cotas seniores será atingida e rentabilidade passada não é garantia de resultado futuro. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do Fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos – FGC. É recomendável a leitura cuidadosa do Regulamento do Fundo pelo cotista, especialmente a seção Fatores de Risco. O indicador utilizado é mera referência econômica e não meta ou parâmetro de performance. Fundos de Investimento podem utilizar estratégias com derivativos como parte de sua política de investimento e dependendo da forma como são utilizadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais. Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para Fundos de Longo Prazo. A Integral formalmente recomenda que o cotista consulte seus próprios assessores de modo a avaliar as informações desta lâmina de modo a determinar, de forma independente e por seu próprio julgamento, sua conclusão e interpretação. A Integral não assume, consequentemente, qualquer responsabilidade por qualquer prejuízo incorrido ou dano, em razão dos investimentos ou interpretações do cotista sobre este relatório. As informações, incluindo, mas não se limitando a, preços, opiniões, estimativas e projeções, aqui contidas refletem uma apreciação da Integral na data de emissão desta lâmina, podendo a mesma ser modificada a qualquer momento, sem qualquer necessidade de aviso ou comunicação prévia. Esta lâmina não constitui, nem tampouco deve ser interpretado como um conselho, recomendação, oferta e/ou solicitação para compra ou venda de títulos, valores mobiliários e/ou de quaisquer outros instrumentos financeiros.



Evolução do passivo (Em R\$ Milhões)



Evolução da subordinação



CNPJ: 37.266.510/0001-15

Objetivo / Política de Investimento

O objetivo do Fundo é proporcionar aos Cotistas a valorização de suas Cotas por meio da aplicação de seu Patrimônio Líquido na aquisição de: (i) Direitos Creditórios, e (ii) Ativos Financeiros, conforme definidos no Regulamento do Fundo

Público Alvo

As Cotas Seniores do Fundo serão subscritas e integralizadas exclusivamente por Investidores Profissionais.

Gestão

Integral Investimentos Ltda.
Endereço: Av. Brig. Faria Lima, 1663,
3º andar, São Paulo, SP
Telefone: (11) 3103-9999
Site: www.integralinvest.com.br

Administração/Custódia

Oliveira Trust DTVM S.A.
Endereço: Av. das Américas, 3434, bloco 7,
sala 201, Rio de Janeiro, RJ
Telefone: (21) 3514-0000
Site: www.oliveiratrust.com.br

Forma de Condomínio: Fechado

Prazo do Fundo: 20 anos

1ª Série Sênior

Início: 31/03/2021

Meta de Remuneração: CDI + 2,75% a.a.

Prazo: 3 anos

PL inicial: R\$ 1.000,00

Rating: S&P 'AAA(bra)'

Dados Gerais da Carteira

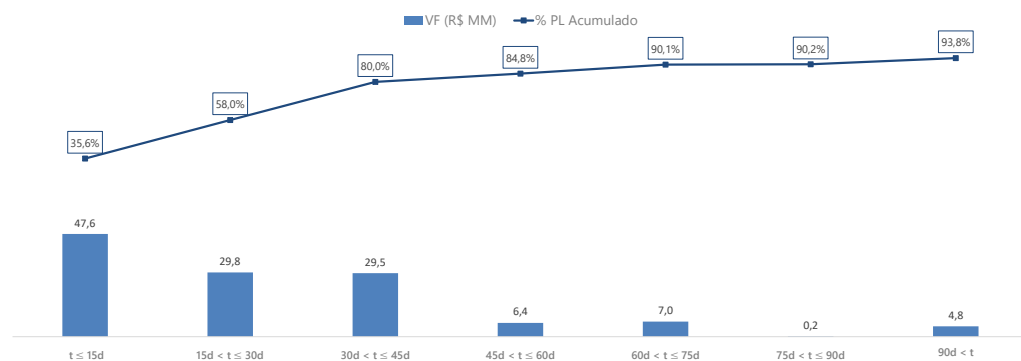
Data Ref. 25/02/2022

Patrimônio Líquido Total	133.445.572,12
% DC	89,34%
Prazo Médio Remanescente dos DCs (dias)	26,42
Prazo Médio dos DCs (dias)	58,79

Taxa Média de Cessão	18,49% a.a.
Ticket Médio dos Direitos Creditórios	19.962,98
Qtde. Devedores no mês	1.187
Qtde. DC originados no mês	6.272

Valor de Face da Carteira por Intervalo de Prazo para Vencimento

Data Ref. 25/02/2022

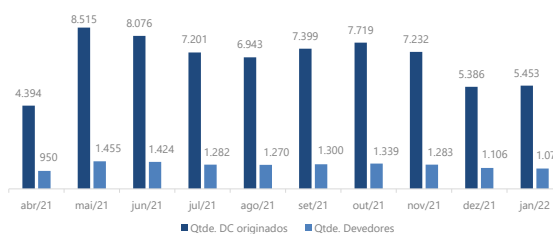


Concentração da Carteira Aberta por Devedor

Data Ref. 25/02/2022

Maiores Devedores	% Total Cart.	% PL
Ambev	16,70%	15,50%
1º Devedor	3,19%	2,96%
2º Devedor	2,98%	2,77%
3º Devedor	2,35%	2,18%
4º Devedor	2,10%	1,95%
Outros (1.082)	72,68%	67,42%

Evolução Mensal de Devedores e Direitos Creditórios



Esta lâmina tem caráter estritamente informativo, e foi preparada pela Integral Investimentos Ltda. exclusivamente para o benefício e uso interno do cotista do Fundo FIDC Calloway não se tratando de oferta de venda de valores mobiliários. A rentabilidade não é líquida de impostos. A existência de uma classe de cotas subordinadas não é garantia que a rentabilidade alvo das cotas seniores será atingida e rentabilidade passada não é garantia de resultado futuro. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do Fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. É recomendável a leitura cuidadosa do Regulamento do Fundo pelo cotista, especialmente a seção Fatores de Risco. O indicador utilizado é mera referência econômica e não meta ou parâmetro de performance. Fundos de Investimento podem utilizar estratégias com derivativos como parte de sua política de investimento e, dependendo da forma como são utilizadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas, podendo inclusive acarretar perdas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais. Não há garantia de que este Fundo terá o tratamento tributário para Fundos de Longo Prazo. A Integral formalmente recomenda que o cotista consulte seus próprios assessores de modo a avaliar as informações desta lâmina de modo a determinar, de forma independente e por seu próprio julgamento, sua conclusão e interpretação. A Integral não assume, consequentemente, qualquer responsabilidade por qualquer prejuízo incorrido ou dano, em razão dos investimentos ou interpretações do cotista sobre este relatório. As informações, incluindo, mas não se limitando a, preços, opiniões, estimativas e projeções, aqui contidas refletem uma apreciação da Integral na data de emissão desta lâmina, podendo a mesma ser modificada a qualquer momento, sem qualquer necessidade de aviso ou comunicação prévia. Esta lâmina não constitui, nem tampouco deve ser interpretado como um conselho, recomendação, oferta e/ou solicitação para compra ou venda de títulos, valores mobiliários e/ou de quaisquer outros instrumentos financeiros.