DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL
Relatório Trimestral – 30/06/2026

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 Fitz Roy Special Situations II FIDC de Responsabilidade Limitada, CNPJ/ME Nº 59999281000180, disciplinado pela Resolução CMN 2.907, pela Instrução CVM 175 e alterações posteriores, apresenta as informações relativas ao 2º trimestre de 2026:

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.

2. PROCEDIMENTO DE VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS DIREITOS CREDITÓRIOS

A verificação do lastro dos Direitos Creditórios será feita trimestralmente, de forma individualizada e integral, por meio da verificação do relatório trimestral, observado o Critério de Elegibilidade previsto no Regulamento.
Sem prejuízo de sua responsabilidade, o Custodiante poderá contratar às expensas do Fundo, terceiro para efetuar a guarda dos Documentos Comprobatórios, nos termos da regulamentação aplicável.
Foi utilizada a data base de 29/05/2026.

2.1 DOS RESULTADOS APRESENTADOS

i) Direitos Creditórios a Vencer:

Documentos representativos do lastro:	Analisados	Inconsistências	% Carteira	% PL
Contratos	2	-	-	-
Nota Comercial	1	-	-	-

ii) Direitos Creditórios Vencidos/Substituídos:

O Fundo não possui direitos creditórios vencidos e/ou substituídos no trimestre.

2.2 DOS REGISTROS DE DIREITOS CREDITÓRIOS

i) Direitos Creditórios Registrados:

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

i) Direitos Creditórios Não Registrados:

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

3. AÇÕES JUDICIAIS, PROCESSOS ADMINISTRATIVOS OU ARBITRAIS

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

Atenciosamente,

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

RELATÓRIO TRIMESTRAL DO GESTOR – ARTIGO 27, §3º, DO ANEXO NORMATIVO II À RESOLUÇÃO CVM Nº 175/22

SEGUNDO TRIMESTRE DE 2026

FITZ ROY SPECIAL SITUATIONS II FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, 59.999.281/0001-80

À BANCO DAYCOVAL S.A. ("Administradora")

Em atendimento à Resolução 175, Artigo 27, inciso V, apresentamos o Demonstrativo Trimestral referente ao FITZ ROY II FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS E RESPONSABILIDADE LIMITADA CNPJ: 59.999.281/0001-80 ("Fundo")

Prezados Senhores,

Segue o relatório contendo as informações previstas no artigo 27, §3º, do Anexo Normativo II à Resolução CVM nº 175/22 e as demais informações que sejam de responsabilidade da Gestora, as quais são necessárias para a elaboração, pela Administradora, do demonstrativo trimestral do Fundo:

1. **Com relação ao eventual ajuizamento de ação judicial de cobrança ou propositura de processo administrativo, judicial ou arbitral envolvendo a classe de cotas, bem como a indicação do percentual do patrimônio envolvido e em risco (alínea c do inciso V do artigo 27 do Anexo Normativo II da Resolução CVM 175):**

   Resposta: Não há ações envolvendo a classe de cotas; o Fundo é parte em ações judiciais estritamente relacionadas aos direitos creditórios adquiridos, as quais são omitidas nos termos do Art. 27, §2º, inciso II, no Anexo Normativo II, da Resolução CMV nº 175.

2. **Com relação às informações contidas no relatório trimestral do gestor a que se refere o § 3º do artigo 27, V, do Anexo Normativo II, da Resolução CVM 175(alínea d do inciso V do artigo 27 do Anexo Normativo II da Resolução CVM 175):**

   Resposta: Vide Relatório do Gestor, nos termos do § 3º do artigo 27, V, do Anexo Normativo II, da Resolução CVM 175 anexo a esta correspondência como Anexo I.

Termos e expressões iniciados em letras maiúsculas, quando utilizados e não definidos de outra forma nesta correspondência, terão o significado que lhes é atribuído no Regulamento.

Atenciosamente,

ANEXO I

Ref.: Relatório da Gestora, nos termos do artigo 27, §3º, do Anexo Normativo II à Resolução CVM nº 175/22, referente ao FITZ ROY II FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS E RESPONSABILIDADE LIMITADA CNPJ: 59.999.281/0001-80, ("Fundo")

Prezados Senhores,

Segue o relatório contendo as informações previstas no artigo 27, §3º, do Anexo Normativo II à Resolução CVM nº 175/22 e as demais informações que sejam de responsabilidade da Gestora, as quais são necessárias para a elaboração, pela Administradora, do demonstrativo trimestral do Fundo:

1. **Houve alguma alteração na política de investimento que afetou a rentabilidade da carteira de ativos? Se sim, descreva os efeitos da alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteira de ativos. Inclua o artigo do regulamento e a data da alteração.**

   Resposta: Durante o período em questão, não houve qualquer alteração na política de investimento que pudesse impactar a rentabilidade da carteira de ativos.

2. **Em relação aos originadores que representem individualmente 10% (dez por cento) ou mais da carteira de direitos creditórios no trimestre:**

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

      Resposta: *Conforme disposto no Regulamento do Fundo.*

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

      Resposta: Não houve.

3. **Houve alterações nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios do Fundo? Se sim, descreva:**

   Resposta: Não houve.

4. **Descreva a forma como se operou a cessão dos Direitos Creditórios, incluindo:**

   a) **descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito;**

      Resposta: *Os Direitos Creditórios foram adquiridos em conformidade com a Política de Investimento do Fundo, mediante análise individualizada de cada operação, junto aos respectivos cedentes, formalizada por meio de instrumentos públicos ou particulares, conforme aplicável.*

   b) **indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão de Direitos Creditórios:**

Resposta: Todas as cessões de direitos creditórios foram realizadas em caráter definitivo.

5. **Houve impacto dos eventos de pré-pagamento no valor do Patrimônio Líquido e na rentabilidade da carteira do Fundo? Se sim, descreva o impacto e justificativa do pré-pagamento.**

   Resposta: Não houve impacto de pré-pagamento no valor do Patrimônio Líquido e na rentabilidade da carteira do Fundo.

6. **Houve alguma alienação, a qualquer título, de Direitos Creditórios Cedidos? Se Sim informe:**

   a) **operação, momento da alienação (antes ou depois do vencimento):**

      Resposta: Não houve alienação, a qualquer título, de direitos creditórios integrantes da carteira do Fundo no período.

   b) **motivação da alienação (inadimplência, oportunidade de negócio, substituição de garantia etc.)**

      Resposta: Não se aplica, uma vez que não houve alienação de direitos creditórios pelo Fundo no período.

7. **Houve algum impacto no valor do Patrimônio Líquido e na rentabilidade da carteira de ativos do Fundo de uma possível descontinuidade, a qualquer título, da originação ou da cessão de Direitos Creditórios? Se sim: Detalhar o impacto no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira de ativos.**

   Resposta: Não aplicável

8. **Descreva informações sobre fatos ocorridos que afetaram a regularidade dos fluxos financeiros oriundos dos Direitos Creditórios Cedidos, incluindo, mas não se limitando a quaisquer eventos que acarretem a liquidação ou a amortização antecipada de Direitos Creditórios Cedidos.**

   Resposta: *Durante o trimestre, foram identificados eventos de inadimplência envolvendo 1 (um) direito creditório integrante da carteira do Fundo.*

   Referidos eventos encontram-se aderentes à política de investimento do Fundo, que contempla a aquisição e a gestão ativa de direitos creditórios não performados (NPL), nos termos previstos em seu regulamento, estando, portanto, dentro do risco esperado da estratégia.

   Em função da inadimplência observada, a Gestora adotou as medidas cabíveis de cobrança e recuperação, incluindo a execução das garantias e, quando aplicável, negociações visando à recomposição dos fluxos financeiros, em conformidade com os procedimentos usuais de gestão de crédito do Fundo.

Os eventos descritos não configuram liquidação ou amortização antecipada de direitos creditórios, nem implicam alteração da política de investimento. Os efeitos financeiros permanecem adequadamente refletidos nas demonstrações do período, observados os critérios de mensuração e provisão previstos na regulamentação vigente e no regulamento do Fundo.
A Gestora segue monitorando a evolução dos créditos inadimplidos e adotando as providências necessárias, mantendo a divulgação das informações relevantes por meio dos relatórios periódicos.

Atenciosamente,

Laplace Capital