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 FUNDO DE INVESTIMENTOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS GCB CRÉDITO MULTIESTRATÉGIA II RESP LIMITADA, CNPJ/ME Nº 64447553000170, 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 30/06/2026.

2.1 DOS RESULTADOS APRESENTADOS

i) Direitos Creditórios a Vencer:

Documentos representativos do lastro:	Analisados	Inconsistências	% Carteira	% PL
CRI	26	-	-	-
CRA	3	-	-	-
Debênture	8	-	-	-

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

DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL
(abril a junho de 2026)

FUNDO DE INVESTIMENTOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS GCB CRÉDITO MULTIESTRATÉGIA II RESPONSABILIDADE LIMITADA
CNPJ: 64.447.553/0001-70
("**Fundo**")

São Paulo, 07 de agosto de 2026.

Prezados investidores,

Encaminhamos o Demonstrativo Trimestral do **FUNDO DE INVESTIMENTOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS GCB CRÉDITO MULTIESTRATÉGIA II RESPONSABILIDADE LIMITADA**, inscrito no CNPJ sob o nº 64.447.553/0001-70, e elaborado nos termos do Anexo II da Resolução CVM nº 175 de 23 de dezembro de 2022, referente ao período de 1º de abril de 2026 a 30 de junho de 2026.

1. **Informações sobre o 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.**

   No referido trimestre, não houve nenhum ajuizamento de ação judicial de cobrança ou propositura de processo administrativo, judicial ou arbitral.

2. **Informações sobre os efeitos de eventual alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteira de ativos.**

   No referido trimestre, não houve nenhuma alteração na política de investimento.

3. **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.

   No referido trimestre, não houve alteração nos critérios para a concessão de crédito, os quais estão dispostos no Regulamento e foram observados pela Gestora.

   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;

   No referido trimestre, não houve alteração nos critérios para a concessão de crédito, os quais estão dispostos no Regulamento e foram observados pela Gestora.

D4Sign 3ba220fe-8afb-4cf9-bf67-ce848ff28648 - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil

4. **Eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios.**

No referido trimestre, não houve alteração nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios.

5. **Sobre forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo:**
   a. **descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito, se houver; e**
   b. **indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão de direitos creditórios;**

Os direitos creditórios cedidos ao Fundo são representados por títulos e valores mobiliários e são adquiridos seguindo padrões de mercado, por meio da subscrição ou da cessão de tais ativos em caráter definitivo.

6. **Impacto dos eventos de pré-pagamento no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira;**

No referido trimestre, não houve nenhum evento de pré-pagamento relacionado aos direitos creditórios.

7. **Condições de alienação, a qualquer título, de direitos creditórios, incluindo:**
   a. **momento da alienação (antes ou depois do vencimento);**
   b. **motivação da alienação;**

No referido trimestre, executamos a alienação dos seguintes ativos:

Código do Ativo	Quantidade	PU (R$)	Valor Total (R$)	Precificação
LCRI02600020	19.925	R$ 10,03792530	R$ 200.005,66	Curva
LCRI02600018	19.738	R$ 10,13290760	R$ 200.003,33	Curva
LCRI02600025	59.868	R$ 10,02210810	R$ 600.003,57	Curva
LCRI02600019	9.794	R$ 10,21115226	R$ 100.008,03	Curva
LCRI02600024	6.083	R$ 10,02948840	R$ 61.009,38	Curva
LCRI02600020	9.945	R$ 10,05542563	R$ 100.001,21	Curva
LCRI02600026	100.000	R$ 9,92036252	R$ 992.036,25	Curva
LCRI02600018	97.939	R$ 10,21047939	R$ 1.000.004,14	Curva
LCRI02600025	137.084	R$ 9,54158101	R$ 1.307.998,09	Curva
LCRI02500016	50.000	R$ 11,73089470	R$ 586.544,74	Curva
LCRI02500042	39.786	R$ 11,34269795	R$ 451.280,58	Curva
LCR002600015	450.000	R$ 8,73142485	R$ 3.929.141,18	Curva
		Total:	**R$ 9.528.036,15**	

D4Sign 3ba220fe-8afb-4cf9-bf67-ce848ff28648 - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil

As alienações foram realizadas com o objetivo de liberar recursos para a aquisição de novas operações, garantindo a manutenção de um nível de caixa saudável para o fundo.

8. **Impacto no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira de ativos de uma possível descontinuidade, a qualquer título, da originação ou cessão de direitos creditórios; e**

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

9. **Informações sobre fatos ocorridos que afetaram a regularidade dos fluxos financeiros oriundos dos direitos creditórios, incluindo, mas não se limitando, a quaisquer eventos que acarretem a liquidação ou amortização antecipada de direitos creditórios.**

   No referido trimestre, não houve nenhum fato que afetasse a regularidade dos fluxos financeiros oriundos dos direitos creditórios.

Atenciosamente,

ivan.ikoma@gcbcapital.com.br
D4Sign
Ivan Valério Ikoma
Assinado

GCB CAPITAL GESTÃO DE RECURSOS DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.
CNPJ nº 39.720.860/0001-35

D4Sign 3ba220fe-8afb-4cf9-bf67-ce848ff28648 - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil