À

Comissão de Valores Mobiliários - CVM

Ref.: Zeus Fundo de Investimentos em Direitos Creditórios

(CNPJ/MF: 34.691.362/0001-98)

Prezados Senhores,

A Actual Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A., na qualidade de Instituição Administradora do Fundo em referência, apresenta abaixo, o demonstrativo trimestral referente ao **2° trimestre de 2026**, informa que todas as operações do fundo foram realizadas dentro das taxas de mercado e o desempenho da carteira de direitos creditórios ficou dentro do esperado.

Informações	**30/06/2026**	
Quantidade de Cotas	67.678,42	
Patrimônio Líquido	R$ 90.714.626,01	
Valor da Cota	R$ 1.340,38	
Composição da Carteira	**30/06/2026**	
	Valor	PL %
Renda Fixa		
Cotas de Fundos		0,00%
Título Privado		0,00%
Título Público		0,00%
Direitos Creditórios		
A vencer	R$ 87.530.656,50	96,49%
Vencidos	R$ 7.931.867,19	8,74%
PDD	-R$ 3.992.420,40	-4,40%
	R$ 91.470.103,29	
Valores a Liquidar		
Contas a Pagar e Receber	-R$ 811.004,20	-0,89%
Depósitos		
Pendências	R$ 53.513,52	0,06%
Disponíveis	R$ 2.013,40	0,00%
Patrimônio Líquido	R$ 90.714.626,01	100,00%

Autorregulação ANBIMA
Gestão de Recursos

1. Análise de resultado e aderência à política de investimentos e limites de composição estabelecidos em Regulamento.

Durante o período analisado, o Fundo apresentou desempenho dentro das expectativas, mantendo sua carteira enquadrada em relação aos limites de composição e diversificação de portfólio estabelecidos no Regulamento e na Instrução CVM nº 175/22, à qual está adequado.

2. Taxas utilizadas nas operações.

Dada a natureza dos direitos creditórios, eles são precificados conforme avaliação do gestor levando em consideração diversas premissas: origem do crédito, perfil da dívida, possibilidade de sucesso na sua recuperação, nível de formalização da operação etc. Dessa forma, não se utiliza uma taxa de desconto necessariamente, mas sim a percepção de êxito na recuperação de tais créditos, mensurado pelo cessionário.

3. Os procedimentos de verificação de lastro por amostragem adotados pelo Custodiante.

A verificação do lastro é realizada, reiteradamente: (i) quando da aquisição de todo e qualquer direito creditório pelo Fundo; e (ii) trimestralmente, considerados apenas os direitos creditórios adquiridos pelo Fundo no período compreendido entre a data-base da última verificação e a data-base da verificação a ser realizada.

Quando realizada por amostragem, a verificação de lastro trimestral dos direitos creditórios se estabelece através da análise de uma amostra estatisticamente relevante extraída de uma população que compreende somente os direitos creditórios integrantes da carteira do Fundo no trimestre de referência.

A seleção dos direitos creditórios que compõem a amostra será obtida de forma a garantir, estatisticamente, o reflexo da carteira do Fundo, considerando sua estrutura e a natureza dos créditos.

4. Resultados da verificação do lastro por amostragem.

a) Resultado

Abaixo, apresentamos os resultados da verificação do lastro, tendo como referência o dia 30/06/2026.

Resultados da verificação do lastro por amostragem

	Quantidade	Valor Nominal	Valor Presente	% Quant	% Valor
Créditos a vencer	974	R$14.500.165,34	R$13.494.412,64	25,81	75,87
Créditos vencidos	913	R$3.093.880,98	R$3.093.880,98	24,19	17,40
PDD	1.887	R$1.197.726,06	R$1.197.726,06	50,00	6,73
Total	3.774	R$18.791.772,38	R$17.786.019,68	100	100
Créditos Analisados a vencer	974	R$14.500.165,34	R$13.494.412,64	25,81	75,87
Créditos analisados vencidos	913	R$3.093.880,98	R$3.093.880,98	24,19	17,40
Créditos Analisados PDD	1.887	R$1.197.726,06	R$1.197.726,06	50,00	6,73
Créditos sem lastro				0	0

b) Composição da amostra

O critério de amostragem dos direitos creditórios no trimestre, que corresponder a seleção de 3.774 (três mil e setecentos e setenta e quatro) itens, foi aplicado e distribuídos da seguinte forma:

- 974 (novecentos e setenta e quatro) itens da carteira de direitos creditórios a vencer dentro do trimestre
- 913 (novecentos e treze) itens da carteira de direitos creditórios vencidos, dentro do trimestre.
- 1.887 (um mil oitocentos e oitenta e sete) itens da carteira de direitos creditórios em PDD, dentro do trimestre.

Cálculo foi efetuado através do estoque que o fundo disponibiliza de títulos junto com os valores em carteira, sendo feito tamanho da população pelo valor dos títulos. Sabendo assim quanto cada tipo itens representa dentro da carteira do fundo. Sob o total de diretos creditórios que o fundo possui.

c) A verificação de lastro

A aplicação deste procedimento visa evidenciar:

- As características dos direitos creditórios são fies aos respectivos registros eletrônicos;
- Os direitos creditórios contidos no arquivo eletrônico estão lastreados.

Assim, com base na amostra selecionada, confrontamos as seguintes informações contidas na base de dados disponibilizada pelo custodiante com só respectivos documentos comprobatórios:

- Nome do Cedente;
- CNPJ do Cedente;
- Nome do Sacado;
- CNPJ/CPF do sacado;
- Data de vencimento;
- Número de ordem do título;
- Valor de Face do Título (Valor Futuro)

d) Contrato / Termo de cessão de Crédito

Todos os 3.774 (três mil e setecentos e setenta e quatro) direitos creditórios analisados apresentam os contratos e termos de cessão de crédito devidamente formalizados.

e) Título de Crédito

Todos os 3.774 (três mil e setecentos e setenta e quatro) direitos creditórios selecionados, são representados por CCBs e contrato físico, e notas comerciais.

f) Documento da Origem do negócio

Todos os 3.774 (três mil e setecentos e setenta e quatro) itens analisados apresentam sua documentação da origem do negócio devidamente formalizado. Feito em plataformas, inserido no sistema Fromtis.

g) Guarda da documentação

Verificamos os controles e procedimento adotado pelo custodiante é feita aguarda do ativo em plataformas onde é espelhado no estoque os dados da operação, o lastro do ativo é feito pela empresa SPC Grafeno, onde o ativo e registro conforme e pedido pela resolução CVM nº 175/22.

h) Consideração Finais

Os documentos comprobatórios de lastro estão arquivos eletronicamente em perfeita ordem, de forma sistemática e de fácil acesso, em ambiente restrito a funcionários autorizados.

5. A natureza dos direitos creditórios a serem adquiridos e dos instrumentos jurídicos, contratos ou outros documentos representativos do crédito.

Não houve alterações no período de referência.

5.a. Descrição dos mecanismos e procedimentos de cobrança dos direitos creditórios, inclusive inadimplentes, coleta e pagamento/rateio destas despesas entre os membros do condomínio, caso assim seja determinado pelo regulamento do fundo.

Não houve alterações no período de referência.

6. Efeitos das alterações apontadas no Item 5 sobre a rentabilidade da carteira.

Não houve alterações no período de referência.

7.a. Alterações nos critérios para a concessão de crédito adotados por originadores que representem, individualmente, 10% ou mais da carteira do fundo no trimestre.

Não houve alterações no período de referência.

7.b. Critérios para a concessão de crédito adotados pelos originadores que representem, individualmente, 10% ou mais da carteira do fundo no trimestre.

Não houve alterações no período de referência.

8. Garantias existentes para o conjunto de ativos.

Não houve alterações nas garantias existentes para o conjunto de ativos no período de referência.

9.a. Descrição de contratos relevantes firmados na cessão dos direitos creditórios ao fundo.

Não houve alterações relevantes na descrição dos contratos de cessão no período de referência.

9.b. Indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão.

Não houve alterações no período de referência.

10. Impacto no valor do patrimônio líquido do fundo e na rentabilidade da carteira dos eventos de pré-pagamento.

Não houve pré-pagamento no período em referência

11. Análise do impacto dos eventos de pré-pagamento descrito no Item 10.

Não se aplica.

12. Condições de alienação, a qualquer título, inclusive por venda ou permuta, de direitos creditórios, incluindo.

Não houve alienações no período de referência.

13. Impacto no valor do patrimônio líquido do fundo e na rentabilidade da carteira de uma possível descontinuidade nas operações de alienação de direitos creditórios realizadas.

Não houve alienações no período de referência.

14. Análise do impacto da descontinuidade das alienações descrito Item 13.

Não se aplica. Não houve alienações no período de referência.

15. Eventos previstos nos contratos firmados para estruturar a operação que acarretaram a amortização antecipada dos direitos creditórios cedidos ao Fundo.

No período analisado, não ocorreu qualquer evento previsto nos contratos firmados que acarretassem amortização antecipada dos direitos creditórios cedidos ao Fundo.

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

No período analisado, não houve ocorrências que afetaram a regularidade dos fluxos de pagamentos previstos.