Quinta-feira, 13 de agosto de 2026

Á COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM
Gerência de Registros III

Relatório Trimestral - 2º trimestre de 2026

Prezados senhores,

Na qualidade de diretor responsável pela administração do Fundo citado abaixo, venho pela presente encaminhar o relatório do trimestre finalizado no período citado acima, conforme artigo 27º, parágrafo 5º, do Anexo II da Instrução CVM 175/2022.

Fundo: FIDC BASSANO DI GRAPPO - CNPJ: 37.645.459/0001-52

I - Os resultados da última verificação do lastro dos direitos creditórios realizado pelo custodiante, nos termos do art. 38 deste Anexo Normativo II, explicitando, dentre o universo analisado, a quantidade e a relevância dos créditos inexistentes porventura encontrados;

a) Verificação da totalidade de vencidos e inadimplidos/substituídos na carteira do fundo no periodo.

Resposta: Foram verificados 1.371 (mil, trezentos e setenta e um) recebíveis, representando a totalidade de direitos creditórios vencidos na carteira do fundo no trimestre, não sendo identificadas divergências. Não houve substituição de direitos creditórios no período.Data base de verificação: 29/05/2026.

II) Os resultados do registro dos direitos creditórios no que se refere à origem, existência e exigibilidade desses ativos, explicitando a quantidade e a relevância dos créditos que não foram aceitos para registro;

Resposta:

CCB's: Foram levadas à registro 973 (Novecentos e setenta e tres) recebiveis, sendo aceita 100% do total passível de registro em 30/06/2026.

Duplictas: Foram levadas à 5.384 (cinco mil trezentos e oitenta e quatro) recebiveis, sendo rejeitado 39,84% do total passível de registro em 30/06/2026.

III) 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;

Resposta: Informação estratégica da gestão do fundo.

IV) Informações contidas no relatório trimestral do gestor a que se refere o § 3º deste artigo:

a) Os efeitos de eventual alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteirade ativos;

Resposta: A rentabilidade da carteira de ativos não foi afeta no período, mas houve alteração no regulamento dia 04/05/26 nos itens abaixo:

a) a alteração da redação do item 4.6 caputs e das alíneas "iv", "v", "vi", bem como a inclusão da alínea "viii", do Anexo Descritivo da Classe de Cotas, que dispõe a respeito dos Critérios de Elegibilidade;

b) a alteração da redação do item 9.1, “iii” do Anexo Descritivo da Classe de Cotas, que dispõe a respeito das matérias específicas a serem deliberadas pela Classe de Cotas;

c) a alteração da redação do item 10.1.1, do Anexo Descritivo da Classe de Cotas, que dispõe a respeito dos procedimentos em caso de verificação de Evento de Avaliação;

d) a alteração da redação do item 10.4, do Anexo Descritivo da Classe de Cotas, que dispõe a respeito dos procedimentos em caso de verificação de Evento de Liquidação Antecipada;

e) a exclusão da redação da alínea “viii”, do 11.4, do Anexo Descritivo da Classe de Cotas, com a consequência renumeração de alíneas posteriores; e

f) a inclusão da redação da alínea “vii”, ao 11.10.1, do Anexo Descritivo da Classe de Cotas, que dispõe a respeito das atribuições aplicáveis à Gestora, com a consequência renumeração de alíneas posteriores.

b) Em relação aos originadores que representem individualmente 10% (dez por cento) ou maisda carteira de direitos creditórios no trimestre:

b1) Critérios para a concessão de crédito adotados pelos originadores, caso tais critérios não tenhamsido descritos no regulamento ou em outros demonstrativos trimestrais; e

Resposta: Critérios estabelecidos no Capítulo 4 do Anexo I do regulamento do Fundo, POLÍTICA DE INVESTIMENTOS E COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA Houve alteração, no dia 04/05/26, da redação do item 4.6 que dispõe a respeito dos Critérios de Elegibilidade, que agora permite a Classe adquirir Direitos Creditórios que estejam em atraso ou que apresentem inadimplemento parcial, independentemente do prazo de vencimento original ou do tempo de mora decorrido na respectiva Data de Aquisição.;.

b2) Eventuais alterações nos critérios para a concessão de crédito adotados por tais originadores,

Resposta: Sem alteração.

c) Eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios

Resposta: Sem alterações nas garantias existentes.

d) Forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo:

d1) Descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito, se houver; e

Resposta: Cessão de duplicatas mercantis, CCB e cessão de recebíveis de cartão de crédito (unidades de recebíveis).

d2) Indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão de direitos creditórios;

Resposta: Definitivo.

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

Resposta: Não houve.

f) Condições de alienação, a qualquer título, de direitos creditórios, incluindo:

f1) Momento da alienação (antes ou depois do vencimento);

Resposta: Não houve.

f2) Motivação da alienação

Resposta: Não houve.

g) Impacto no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira de ativos de umapossível descontinuidade, a qualquer título, da originação ou cessão de direitos creditórios;e

Resposta: Não houve.

h) Informações sobre fatos ocorridos que afetaram a regularidade dos fluxos financeirosoriundos dos direitos creditórios, incluindo, mas não se limitando, a quaisquer eventos que acarretem naliquidação ou amortização antecipada de direitos creditórios.

Resposta: Não houve.

V) No caso de classe destinada ao público em geral que adquira precatórios federais:

a) Se o precatório permanece na ordem de pagamento da União;

Resposta: Não se aplica.

b) Sobre eventual existência de impugnação judicial ou fatos supervenientes capazes de alterar a ordem ou o prazo de pagamento do precatório e avaliação, fundamentada, sobre a chance de êxito das impugnações.

Resposta: Não se aplica.