DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL – 2º TRIMESTRE 2026

Fundo: **CHIMERA ALTERNATIVE ASSETS XII SR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIDC RESP LIMITADA**
CNPJ: **61.085.704/0001-07**
Data base: **30 de Junho de 2026**

Em atendimento ao disposto no artigo 27º, do anexo II da Instrução CVM nº 175, de 23 de dezembro de 2022, segue:

Informações da carteira do fundo e cumprimento da alocação mínima em direitos creditórios:

I) Composição da carteira:

Composição	Valor Mercado Atual (R$)	% PL
Classes de Cotas de Fundos de Investimentos em Dir. Creditório	R$94.003.732,52	99,84%
Classes de Cotas dos FIF - Anexo I da RCVM 175	R$435.047,36	0,46%
	R$0,00	100,30%

Outros Ativos	R$16.193,73	0,02%
Passivo	R$296.036,87	0,31%
Patrimônio líquido	R$94.158.936,74	100%

II) Os resultados da última verificação do lastro dos direitos creditórios realizado pelo custodiante:

a. Metodologia:
Conforme previsto no Art. 38 do Anexo II da Instrução 175, o custodiante dos direitos creditórios deve verificar a existência, integridade e titularidade do lastro dos direitos creditórios que ingressaram na carteira no período a título de substituição, assim como o lastro dos direitos creditórios vencidos e não pagos no mesmo período.

b. Conclusão:
Não aplicável, pois trata-se de um FIDC de Cotas.

III) 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:

Não aplicável, pois trata-se de um FIDC de Cotas.

Atenciosamente,
Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliário Ltda.

São Paulo, 20 de julho de 2026.

À

VÓRTX DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA ("Vórtx")
A/C ADMINISTRAÇÃO DE FUNDOS
Rua Gilberto Sabino, nº 215, 4º andar. São Paulo/SP.

Ref.: Relatório Trimestral referente ao 2ºTRI/2026, CHIMERA ALTERNATIVE ASSETS XII SR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA

Prezados Senhores,

CHIMERA CAPITAL ASSET MANAGEMENT LTDA. ("Chimera Asset"), com sede social na Rua Joaquim Floriano, nº 1052, 13º andar, Itaim Bibi, na Cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, CEP 04534-004, inscrita no CNPJ/ME sob o nº 37.332.689/0001-61, vem, por meio da presente, em atendimento ao disposto nos artigos 27 e 36 do Anexo II da Resolução CVM nº175, de 23 de dezembro de 2022, informar o quanto segue:

CHIMERA ALTERNATIVE ASSETS XII SR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, inscrito no CNPJ nº **61.085.704/0001-07** ("Fundo"), administrado pela Vórtx, e sob gestão da Chimera Asset, **realizou a aquisição de cotas de Fundos de Investimento em Direitos Creditórios entre 01/04/2026 e 30/06/2026.** Ainda, referente ao mesmo período, nenhum dos ativos presentes na carteira venceu ou foi substituído.

(i) Política de investimento e limites de composição e diversificação:
A Política de Investimento está disposta no Capítulo 7, do Anexo I do Regulamento do Fundo.

D4Sign 02c77136-7d58-42f1-9f18-a8bc583315cd - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil

(ii) Procedimentos de verificação de lastro adotados pelo Gestor:
O procedimento de verificação de lastro é realizado de forma individualizada. Considerando a natureza dos ativos adquiridos, o(s) seguinte(s) documentos(s) foi(ram) verificado(s): 1. Regulamento e registro da oferta perante a CVM.

(iii) 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:
Não houve ajuizamento de ações judiciais ou propositura de processo administrativo, judicial ou arbitral no período.

(iv) Os efeitos de eventual alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteira de ativos:
Não houve alterações na política de investimento.

(v) 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;
Não se aplica.

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:
Não se aplica.

(vi) Eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios
Não se aplica.

(vii) A forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo:

a) descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito, se houver:
Não aplicável.

b) indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão de direitos creditórios:
Não aplicável.

(viii) Impacto dos eventos de pré-pagamento no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira:
Não ocorreram eventos de pré-pagamento.

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

a) momento da alienação (antes ou depois do vencimento):
Não se aplica.

D4Sign 02c77136-7d58-42f1-9f18-a8bc583315cd - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil

b) motivação da alienação;
Não se aplica.

(x) 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:
Não se aplica.

(xi) 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 na liquidação ou amortização antecipada de direitos creditórios:
Não se aplica.

É o que cumpria informar para o momento.

Cordialmente,

CHIMERA CAPITAL ASSET MANAGEMENT LTDA.
Rafael Fonseca Nogueira
Diretor de Gestão

D4Sign 02c77136-7d58-42f1-9f18-a8bc583315cd - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil

Relatório trimestral + Verificação de Lastro 2TRI - FICFIDC XII SR pdf

Código do documento 02c77136-7d58-42f1-9f18-a8bc583315cd

Assinaturas

Rafael Fonseca Nogueira
rnogueira@chimeracapital.com.br
Assinou

Rafael Fonseca Nogueira

Eventos do documento

24 Jul 2026, 16:07:41
Documento 02c77136-7d58-42f1-9f18-a8bc583315cd **criado** por BEATRIZ CRISTINA DA FONSECA RODRIGUES (5f44048a-a5fc-45f8-a062-5252ceb5d4ec). Email:brodrigues@chimeracapital.com.br. - DATE_ATOM: 2026-07-24T16:07:41-03:00

24 Jul 2026, 16:13:45
Assinaturas **iniciadas** por BEATRIZ CRISTINA DA FONSECA RODRIGUES (5f44048a-a5fc-45f8-a062-5252ceb5d4ec). Email: brodrigues@chimeracapital.com.br. - DATE_ATOM: 2026-07-24T16:13:45-03:00

24 Jul 2026, 17:45:06
RAFAEL FONSECA NOGUEIRA **Assinou** - Email: rnogueira@chimeracapital.com.br - IP: 187.102.179.186 (mvx-187-102-179-186.mundivox.com porta: 32796) - Geolocalização: -23.58610593749814 -46.68025612199839 - Documento de identificação informado: 299.298.108-70 - **Assinado com EMBED** - Token validado por **email** - DATE_ATOM: 2026-07-24T17:45:06-03:00

Hash do documento original
(SHA256):e0d4c3e3a61cdf4b214998b0771fb56e70f5ece06e01d9a1bbdc7faafeff901c
(SHA512):a4910338efc98c66aa5ec064db6567c39e0b82b76036f261ef2def9e275dc120f593b7828ec2aae115c4f30fcef528e09e309643b977d4d35d232f9050a5a42b

Esse log pertence **única** e **exclusivamente** aos documentos de HASH acima

Esse documento está assinado e certificado pela D4Sign
Integridade certificada no padrão ICP-BRASIL
Assinaturas eletrônicas e físicas têm igual validade legal, conforme **MP 2.200-2/2001** e **Lei 14.063/2020**.