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 FATOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS, CNPJ/ME Nº 49260024000179, 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:

Durante o trimestre em referência, o Fundo não realizou a aquisição de Direitos Creditórios.

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

São Paulo, 10 de Agosto.

Ao
Banco Daycoval S.A.
Prezados Senhores,
Em cumprimento ao disposto no capítulo VI da RCVM 175, solicitamos as informações
Denominação Social
FATOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS
CCNPJ 49.789.715/0001-64

Período de referência: **01/04/2026 a 30/06/2026**

Conforme o capítulo VI, art. 27 – alíneas "c" e "d", precisamos que nos enviem as informações descritas, caso aplicáveis:

1. 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;

   NÃO SE APLICA

2. Informações contidas no relatório trimestral do gestor a que se refere o § 3º deste artigo;

   NÃO SE APLICA

Em complemento à solicitação, os §§ 2º e 3º:

§ 2º A informação de que trata a alínea "c" do inciso V do caput:

I. pode ser dada de forma agregada, caso a quantidade e valores envolvidos nas ações judiciais e arbitrais assim justifiquem;

   NÃO SE APLICA

II. pode ser omitida do demonstrativo trimestral, a critério do gestor, caso sua divulgação possa prejudicar a estratégia de cobrança ou fomentar a inadimplência de direitos creditórios.

   NÃO SE APLICA

§ 3º Para efeitos da alínea "d" do inciso V do caput, o gestor deve elaborar e encaminhar ao administrador, em até 40 (quarenta) dias após o encerramento do trimestre civil a que se referir, relatório contendo:

I. os efeitos de eventual alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteira de ativos;

NÃO SE APLICA

II. 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

III. eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios;

NÃO SE APLICA

IV. forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo:

a. descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito, se houver;

NÃO SE APLICA

b. indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão de direitos creditórios;

NÃO SE APLICA

V. impacto dos eventos de pré-pagamento no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira;

VI. NÃO SE APLICA

VII. condições de alienação, a qualquer título, de direitos creditórios, incluindo:

a. momento da alienação (antes ou depois do vencimento);

NÃO SE APLICA

b. motivação da alienação;

NÃO SE APLICA

VIII. 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

IX. 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.

Duas Notas Comerciais de um único devedor em comum foram renegociadas com prorrogação de prazo e indexado. Dado o percentual representativo das Notas Comerciais no portifólio não houve descasamento de fluxos com nosso passivo.

Cordialmente,

_____

FAR - FATOR ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA