DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL – 2º TRIMESTRE 2026

Fundo: **F3 FALCON FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS RESPONSABILIDADE LIMITADA**

CNPJ: 58.561.243/0001-89
1ª Integralização de Cotas: **30/12/2024**

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) Limites de Composição:

Em até 180 (cento e oitenta) dias da Data da 1ª Integralização, a Classe deverá possuir parcela superior a 50,00% do seu Patrimônio Líquido representada por Direitos Creditórios.

a. Composição da Carteira em

Composição	Valor Mercado Atual (R$)	Quantidade de Direitos Creditórios	% PL
Direitos Creditórios Adimplentes	R$151.475.994,54	454.098	80,56%
Direitos Creditórios Inadimplentes	R$17.306.171,85	44.533	9,20%
Total	R$168.782.166,39	498.631	89,77%
PDD	R$8.621.250,64		4,59%

Outros Ativos	R$31.350.530,56		16,67%
Passivo	R$3.988.274,2		2,12%
Patrimônio líquido	R$188.024.680,81		100,00%

b. Aquisições no trimestre:

Quantidade de Direitos Creditórios	Valor Mercado Atual (R$)
102153	**R$30.555.267,83**

c. Taxas:
As negociações foram realizadas com as taxas de mercado

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. População de títulos vencidos e não liquidados no trimestre:

Quantidade de Direitos Creditórios	Valor Mercado Atual (R$)
33.888	**R$13.111.580,51**

c. População de títulos substituídos no trimestre:

Quantidade de Direitos Creditórios	Valor Mercado Atual (R$)
0	**R$0,00**

II) Resultado da verificação de lastro por amostragem ou não, realizada pelo custodiante, explicitando, dentre o universo analisado, a quantidade e a relevância dos créditos inexistentes porventura encontrados:

Composição	Amostra	Quant. Inconsistências	% de inconsistências	Quant. Itens pendentes	% de pendência	Valor de Mercado Atual
Direitos Creditórios Substituídos (a)	0	0	0,00%	0	0,00%	R$0,00
Direitos Creditórios Inadimplentes	33.888	0	0,00%			R$13.111.580,51
Total	**33.888**	**0**	**0,00%**			**R$13.111.580,51**

[1] validamos a documentação comprobatória de recebíveis, que representam a totalidade de 0 direitos creditórios substituídos.
[2] validamos a documentação comprobatória de 16987 recebíveis, que representam a totalidade de 33888 parcelas inadimplentes.

Conclusão:

O processo de verificação do lastro trimestral está em andamento, e as informações serão reapresentadas após a conclusão das análises.

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:

	Quantidade	Valor
Direitos Creditórios Registrados	3	R$14.378,87
Direitos Creditórios Rejeitados	0	R$0,00

Atenciosamente,

Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliário Ltda.

Docusign Envelope ID: 36472186-5AC0-8213-82CC-29CCDE904EF1

Demonstrativo trimestral – 2º trimestre de 2026

Fundo: F3 FALCON FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS
CNPJ: 58.561.243/0001-89
Data base: 30/06/2026

Abaixo, destacamos as alíneas “c” e “d” do inciso V que complementam a solicitação do artigo 27 da ICVM 175.

c) 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 aplicável. O Fundo não possui ações ajuizadas.

d) informações contidas no relatório trimestral do gestor a que se refere o § 3º do artigo 27:

I – Os efeitos de eventual alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteira de ativos;

Não aplicável. O fundo não sofreu alteração na política de investimentos.

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; e

Não aplicável. Todos os critérios de elegibilidade do fundo estão descritos no regulamento, sendo rigorosamente aplicados e monitorados.

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 aplicável.

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

Não aplicável.

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

Não aplicável.

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

Não aplicável.

Docusign Envelope ID: 36472186-5AC0-8213-82CC-29CCDE904EF1

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

Não aplicável.

VI – Condições de alienação, a qualquer título, de direitos creditórios, incluindo:

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

Venda de direitos creditórios (Vencidos): R$ 1.011.077,93 (28/04/2026) : R$ 2.960.415,06 (30/06/2026).

b) motivação da alienação;

Venda de direitos creditórios vencidos para ajuste de perfil de risco.

VII – 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

Não aplicável. Em caso de descontinuidade da originação, o fundo manteria sua rentabilidade média com os ativos já adquiridos em carteira.

VIII – 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 houve qualquer evento que tenha afetado a regularidade dos fluxos financeiros, trazendo a necessidade de liquidação antecipada de direitos creditórios.

e) no caso de classe destinada ao público em geral que adquira precatórios federais:

1. se o precatório permanece na ordem de pagamento da União; e

Não aplicável.

2. 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.

Não aplicável.

Fernando Augusto Barros Silveira Bueno

F3 ROCK GESTÃO DE RECURSOS LTDA
26.602.733/0001-90