DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL – 2º TRIMESTRE 2026

Fundo: **MCP FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA**

CNPJ: 62.682.486/0001-42
1ª Integralização de Cotas: **31/10/2025**

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 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$409.975.325,67	1.003.916.188	81,92%
Direitos Creditórios Inadimplentes	R$13.805.734,71	49.008	2,76%
Total	R$423.781.060,38	1.003.965.196	84,68%
PDD	R$4.634.621,63		0,93%

Outros Ativos	R$90.062.822,66		18,00%
Passivo	R$8.762.434,6		1,75%
Patrimônio líquido	R$500.454.090,62		100,00%

b. Aquisições no trimestre:

Quantidade de Direitos Creditórios	Valor Mercado Atual (R$)
1782465	**R$248.161.460,83**

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$)
45.601	**R$12.863.500,65**

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	45.601	0	0,00%			R$12.863.500,65
Total	**45.601**	**0**	**0,00%**			**R$12.863.500,65**

[1] validamos a documentação comprobatória de recebíveis, que representam a totalidade de 0 direitos creditórios substituídos.
[2] validamos a documentação comprobatória de 37671 recebíveis, que representam a totalidade de 45601 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	60.642	R$552.894.909,34
Direitos Creditórios Rejeitados	0	R$0,00

Atenciosamente,

Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliário Ltda.

Demonstrativo trimestral – 2º trimestre de 2026

Fundo: MCP FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA
CNPJ: 62.682.486/0001-42
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.

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 houve alteração na política de investimentos durante o período analisado.

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

No período analisado, não houve alterações nos critérios para a concessão de crédito adotados pelos originadores. As Cédulas de Crédito Bancário (CCBs) de Consignado Privado adquiridas pelo FIDC no trimestre foram originadas com base em análise de elegibilidade do tomador, verificação da margem consignável disponível, capacidade de desconto em folha de pagamento e conformidade com os limites regulatórios vigentes, redefinidos pela Lei nº 15.179/2025, conforme previsto no Regulamento. No mais, o fundo apresentou uma performance dentro das expectativas, mantendo sua carteira enquadrada em relação aos limites de composição e diversificação de portfólio estabelecidos no regulamento e na instrução RCVM 175.

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 ocorreram alterações quanto aos critérios de concessão de crédito da Classe no trimestre analisado.

Clicksign 840bac9f-3f23-4c35-9a9f-6e0e34e5734c

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

Não ocorreram alterações nas garantias existentes no trimestre analisado.

IV – Forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo:

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

Não houve contratos relevantes firmados no período do trimestre analisado.

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

Definitivo.

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

No período analisado, praticamente não houve pré-pagamentos frente ao total da carteira. Nesse sentido, os impactos desses pré-pagamentos sobre carteira ou patrimônio líquido foram irrelevantes.

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

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

Não aplicável.

b) motivação da alienação;

Não aplicável.

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 houve descontinuidade relevante na originação de direitos creditórios no período analisado.

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

Clicksign 840bac9f-3f23-4c35-9a9f-6e0e34e5734c

Não houve ocorrências que afetaram a regularidade dos fluxos de pagamentos previstos.

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.

_____

MILÊNIO CAPITAL GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA.
CNPJ: 16.804.280/0001-20

Clicksign 840bac9f-3f23-4c35-9a9f-6e0e34e5734c

2026 2ºtri DT Gestor MCP.docx

Documento número #840bac9f-3f23-4c35-9a9f-6e0e34e5734c

Hash do documento original (SHA256): 5a567e876d4e27eae211a17776e36f1372d193f995fff2dff4b0c54062c32b91

Hash do PAdES (SHA256): 7b57e949cfcc3cd7be782b28a8f1b79436faf23fb165c961debdb35e93e872a7

Assinaturas

ALINE SABINO DO NASCIMENTO

CPF: 425.779.988-99

Assinou como gestor em 30 jul 2026 às 10:36:29

Emitido por AC LINK RFB v2- com Certificado Digital ICP-Brasil válido até 16 set 2026

Rodrigo Canavarro Vieira Gomes

CPF: 146.736.467-38

Assinou como gestor em 31 jul 2026 às 17:21:56

Emitido por AC LINK RFB v2- com Certificado Digital ICP-Brasil válido até 15 set 2026

Log

30 jul 2026, 09:50:30	Operador com email lcardoso@milenio.capital na Conta b4b395ec-a542-41dc-ae88-80977d17f54e criou este documento número 840bac9f-3f23-4c35-9a9f-6e0e34e5734c. Data limite para assinatura do documento: 29 de agosto de 2026 (09:50). Finalização automática após a última assinatura: habilitada. Idioma: Português brasileiro.
30 jul 2026, 09:58:02	Operador com email lcardoso@milenio.capital na Conta b4b395ec-a542-41dc-ae88-80977d17f54e adicionou à Lista de Assinatura: gcardoso@milenio.capital para assinar como gestor, via E-mail. Pontos de autenticação: Certificado Digital; Nome Completo; CPF. Dados informados pelo Operador para validação do signatário: nome completo Gabriel Marcus de Freitas Cardoso e CPF 147.732.427-52.
30 jul 2026, 09:58:02	Operador com email lcardoso@milenio.capital na Conta b4b395ec-a542-41dc-ae88-80977d17f54e adicionou à Lista de Assinatura: asabino@milenio.capital para assinar como gestor, via E-mail. Pontos de autenticação: Certificado Digital; Nome Completo; CPF. Dados informados pelo Operador para validação do signatário: nome completo ALINE SABINO DO NASCIMENTO e CPF 425.779.988-99.
30 jul 2026, 10:36:29	ALINE SABINO DO NASCIMENTO assinou como gestor. Pontos de autenticação: certificado digital, tipo A1 e-cpf. CPF informado: 425.779.988-99. IP: 177.92.83.214. Componente de assinatura versão 1.1487.0 disponibilizado em https://app.clicksign.com.

31 jul 2026, 17:20:15	Operador com email lcardoso@milenio.capital na Conta b4b395ec-a542-41dc-ae88-80977d17f54e removeu da Lista de Assinatura: gcardoso@milenio.capital para assinar como gestor.
31 jul 2026, 17:20:15	Operador com email lcardoso@milenio.capital na Conta b4b395ec-a542-41dc-ae88-80977d17f54e adicionou à Lista de Assinatura: rcanavarro@milenio.capital para assinar como gestor, via E-mail. Pontos de autenticação: Certificado Digital; Nome Completo; CPF. Dados informados pelo Operador para validação do signatário: nome completo Rodrigo Canavarro Vieira Gomes e CPF 146.736.467-38.
31 jul 2026, 17:21:56	Rodrigo Canavarro Vieira Gomes assinou como gestor. Pontos de autenticação: certificado digital, tipo A1 e-cpf. CPF informado: 146.736.467-38. IP: 177.92.83.214. Componente de assinatura versão 1.1488.0 disponibilizado em https://app.clicksign.com.
31 jul 2026, 17:22:04	Processo de assinatura finalizado automaticamente. Motivo: finalização automática após a última assinatura habilitada. Processo de assinatura concluído para o documento número 840bac9f-3f23-4c35-9a9f-6e0e34e5734c.

ICP Brasil

Documento assinado com validade jurídica.
Para conferir a validade, acesse https://www.clicksign.com/validador e utilize a senha gerada pelos signatários ou envie este arquivo em PDF.
As assinaturas digitais e eletrônicas têm validade jurídica prevista na Medida Provisória nº. 2200-2 / 2001

Este Log é exclusivo e deve ser considerado parte do documento nº 840bac9f-3f23-4c35-9a9f-6e0e34e5734c, com os efeitos prescritos nos Termos de Uso da Clicksign, disponível em www.clicksign.com.