DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL
Relatório Trimestral – 30/09/2026

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 MILÊNIO PFN FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, CNPJ/ME Nº 54994858000148, em atendimento ao disposto no artigo 27, inciso V da Resolução CVM 175, apresenta as informações relativas ao 3º trimestre de 2026:

1. INFORMAÇÕES DO CUSTODIANTE – ART. 27, INCISO V, ALÍNEA “A”)

i) Direitos Creditórios Vencidos:

	Quantidade	Valor Presente	% Carteira	% PL
Créditos Inadimplidos	0	-	-	-
Créditos Inexistentes	0	-	-	-

ii) Direitos Creditórios Substituídos:

	Quantidade	Valor Presente	% Carteira	% PL
Créditos Substituídos	0	-	-	-
Créditos Inexistentes	0	-	-	-

2. INFORMAÇÕES DO ADMINISTRADOR – ART. 27, INCISO V, ALÍNEA “B”)

i) 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	%PL
Direitos Creditórios Registrados	Não aplicável	-
Direitos Creditórios Não Registrados	Não aplicável	-

ii) 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.

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

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

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;

Não se aplica.

3. INFORMAÇÕES DO GESTOR – ART. 27, INCISO V, ALÍNEA "D")

Anexo.

Atenciosamente,

BANCO DAYCOVAL S.A.
CNPJ 62.232.889/0001-90
Administrador do Fundo

MILENIO
CAPITAL

Demonstrativo trimestral – 3º trimestre de 2026

Fundo: MILENIO PFN FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA
CNPJ: 54.994.858/0001-48
Data base: 30/09/2026

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;

Nada a reportar.

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;

Nada a reportar.

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

Nada a reportar.

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;

Nada a reportar.

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

Nada a reportar.

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

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

No trimestre, a classe adquiriu direitos creditórios, representados por cotas de FIDC, no montante de R$ 6.873.102,79, por meio de subscrição e integralização em chamadas de capital dos FIDCs investidos, formalizadas pelos respectivos boletins de subscrição e nos termos dos regulamentos desses fundos.

Clicksign 401a14ac-23ef-4d2b-8ed8-6a5266c30919

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

As aquisições foram realizadas em caráter definitivo, com a transferência integral à classe da titularidade das cotas subscritas.

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

Nada a reportar.

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

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

Ao longo do trimestre, efetuamos a venda de R$ 1.629.502,17 em cotas no secundário.

b) motivação da alienação;

A venda teve como objetivo gerar liquidez para atender ao resgate de cotas de R$ 5.000.000,00 realizado em agosto de 2026.

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

Nada a reportar.

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

Em 15/09/2026, foi realizada a remarcação de direitos creditórios integrantes da carteira de um dos FIDCs investidos pela classe. No trimestre, dois FIDCs investidos pela classe entraram em regime de liquidação, passando os fluxos de suas carteiras a ser destinados à amortização de suas cotas, nos termos dos respectivos regulamentos.

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

Nada a reportar.

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.

Nada a reportar.

Clicksign 401a14ac-23ef-4d2b-8ed8-6a5266c30919

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

Clicksign 401a14ac-23ef-4d2b-8ed8-6a5266c30919