DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL – 3º TRIMESTRE 2026

Fundo: **CHIMERA NPL & SPECIAL OPPORTUNITIES II FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILI**

CNPJ: 52155823000190

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:

Os critérios de composição, enquadramento e concentração da carteira de direitos creditórios seguirão o disposto no regulamento do fundo, que estabelece os respectivos percentuais e limites.

a. Composição da Carteira em

Composição	Valor Mercado Atual (R$)	Quantidade de Direitos Creditórios	% PL
Direitos Creditórios Adimplentes	R$139.855.391,17	6.568.230	68,80%
Direitos Creditórios Inadimplentes	R$8.848,99	3	0,00%
Total	R$139.864.240,16	6.568.233	68,81%
PDD	R$5.184,66		0,00%

Outros Ativos	R$64.941.001,09		31,95%
Passivo	R$ 1.669.029,88		0,82%
Patrimônio líquido	R$ 203.274.530,21		100,00%

b. Aquisições no trimestre:

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

c. Taxas:
Não houve aquisições durante o trimestre

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$)
3	R$8.848,99

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	3	0	0,00%	0	0,00%	R$8.848,99
Total	**3**	**0**	**0,00%**	**00**	**00,00%**	**R$8.848,99**

[1] validamos a documentação comprobatória de 0 recebíveis, que representam a totalidade de direitos creditórios substituídos que permaneceram no estoque até a data-base.
[2] validamos a documentação comprobatória de 3 recebíveis, que representam a totalidade de 3 parcelas inadimplentes.

Conclusão:

Com base nos procedimentos realizados durante a verificação de lastro, de acordo com o artigo 27º, do anexo II da Instrução CVM nº 175, concluímos que, para os itens selecionados para inspeção, não foram identificadas pendências ou inconsistências significativas nos direitos creditórios, tanto em relação às substituições, quanto aos itens inadimplentes no trimestre findo em 30 de setembro de 2026. Além disso, avaliamos possíveis inconsistências no trimestre anterior e constatamos que não houve irregularidades presentes no atual semestre.

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	0	R$0,00
Direitos Creditórios Rejeitados	0	R$0,00

Atenciosamente,

Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliário Ltda.

São Paulo, 08 de outubro de 2026.

À

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

Ref.: Relatório Trimestral referente ao 3º TRI/2026, CHIMERA NPL & SPECIAL OPPORTUNITIES II 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 NPL & SPECIAL OPPORTUNITIES II FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, inscrito no CNPJ nº 52.155.823/0001-90 ("Fundo"), administrado pela Vórtx, e sob gestão da Chimera Asset, **realizou a aquisição de Direitos Creditórios entre 01/07/2026 e 30/09/2026. Ainda, referente ao mesmo período, nenhum dos ativos presentes na carteira foi substituído.**

(i) Política de investimento e limites de composição e diversificação:
A Política de Investimento está disposta no Capítulo 4, do Anexo I do Regulamento do Fundo.

D4Sign 01a16a2e-98b5-7865-b9bb-d832d3896fac - 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 direitos creditórios, o(s) seguinte(s) documento(s) foi(ram) verificado(s): 1. Autos do(s) processo(s) judicial(is) relacionado(s) ao direito creditório; 2. Nota Comercial, 3. Regulamento e registro da oferta perante CVM; 4. Documentos societários do emissor;

(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 ação judicial de cobrança 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 se aplica.

(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:
Para todos os direitos creditórios foram firmados instrumentos particulares e/ou públicos para formalização da aquisição.

b) indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão de direitos creditórios:
Todas as cessões têm caráter definitivo.

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

D4Sign 01a16a2e-98b5-7865-b9bb-d832d3896fac - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil

(ix) 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.

(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 01a16a2e-98b5-7865-b9bb-d832d3896fac - Para confirmar as assinaturas acesse https://secure.d4sign.com.br/verificar
Documento assinado eletronicamente, conforme MP 2.200-2/01, Art. 10º, §2. Brasil