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 SATYA FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, CNPJ/ME Nº 59665305000165, 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	1	43.237,60	1,02%	0,93%
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	13	29,18%
Direitos Creditórios Não Registrados	8	59,24%

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

DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL

SATYA FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS-

59.665.305/0001-65

3º TRIMESTRE DE 2026

	R$	%PL
Operações de Crédito	R$ 4.118.888,25	83.61%
Cotas de Fundos	R$ 441.583,70	8.96%
Disponibilidades	R$1.974,93	0.04%
Compromissadas	R$0,00	0.0%
Títulos Públicos	R$0,00	0.0%
Títulos Privados	R$0,00	0.0%
Derivativos	R$ 0,00	0.0%
PDD	R$1.297,13	0.03%
Valores a Receber / Pagar	R$21.698,54	0.44%
PL	R$4.926.174,85	100.0%
PL - Bruto	R$4.926.174,85	100.0%
Receitas	R$	%
Despesas	R$	%

1 - Análise de resultado e aderência à política de investimentos e limites de composição estabelecidos em Regulamento.

Durante o período analisado, o Fundo apresentou uma performance dentro das expectativas.

2 - Taxas utilizadas nas operações.

A taxa mensal de deságio utilizada nas operações é de 1,56%.

3 - Os procedimentos de verificação de lastro por amostragem adotados pela Gestora.

Conforme estabelece a Resolução CVM 175/2022, a Gestora adota metodologia para realização da verificação de lastro dos direitos creditórios integrantes da carteira do Fundo. Ressalta-se que, conforme prerrogativa da referida Instrução, em fundos em que haja significativa quantidade de créditos cedidos e expressiva diversificação de devedores, a Gestora poderá realizar a verificação do lastro dos direitos creditórios por amostragem. Independentemente da realização de verificação de lastro de direitos creditórios ser realizada por amostragem ou não, é facultado a Gestora contratar, empresa para a prestação do referido serviço.

A verificação de lastro dos direitos creditórios realizada pela Gestora ou por terceiro contratado ocorre através de criteriosa inspeção dos documentos representativos dos créditos, levando-se em conta as evidências de validade, legalidade, veracidade, formalidade, completude e exequibilidade dos direitos creditórios e, ainda, a forma como se realizaram as cessões para o Fundo.

A verificação do lastro é realizada, reiteradamente: (i) quando da aquisição de todo e qualquer direito creditório pelo Fundo; e (ii) trimestralmente, considerados apenas os direitos creditórios adquiridos pelo Fundo no período compreendido entre a data-base da última verificação e a data base da verificação a ser realizada.

Quando realizada por amostragem, a verificação de lastro trimestral dos direitos creditórios se estabelece através da análise de uma amostra estatisticamente relevante extraída de uma população que compreende somente os direitos creditórios "a vencer" integrantes da carteira do Fundo no trimestre de referência.

A seleção dos direitos creditórios que compõem a amostra será obtida de forma a garantir, estatisticamente, o reflexo da carteira do Fundo, considerando sua estrutura e a natureza dos créditos. Parcela da amostra dos direitos creditórios assume a variável de representatividade de risco, inerente aos principais Cedentes e/ou Devedores dos créditos, sendo complementada por outros créditos selecionados a partir de sorteios realizados em intervalo de retirada, estabelecidos através da razão entre o tamanho da população e o tamanho da própria amostra, de forma a contemplar o critério de aleatoriedade.

Importante frisar que a métrica de seleção não se aplica para os créditos inadimplentes e para os substituídos no período de referência. No caso de existirem direitos creditórios vencidos na data base da verificação a ser realizada ou se o Fundo realizou substituições de créditos no trimestre de referência, o Custodiante deverá proceder com a análise da totalidade do lastro dos referidos direitos creditórios, independentemente da verificação integral do lastro quando da aquisição dos direitos creditórios pelo Fundo, conforme informado anteriormente.

Abaixo, apresentamos os resultados da verificação do lastro, tendo como referência o dia 31/08/2026**,** data em que a população e a amostra foram definidas, de acordo com a fórmula e os critérios de seleção estabelecidos no Regulamento do Fundo.

4 - Resultados da verificação do lastro por amostragem.

	Quantidade	Valor Nominal	Valor Presente
Créditos a vencer na data de verificação	23	R$ 4.382.996,99	R$ 4.201.907,27
Créditos a vencer (analisados)	22	R$ 3.545.042,95	R$ 3.391.771,63
	Quantidade	**Valor Nominal**	**Valor Liquidado**
Créditos vencidos na data de verificação	1	R$ 43.237,60	R$ 43.237,60
Créditos vencidos (analisados)	1	R$ 43.237,60	R$ 43.237,60
	Quantidade	**Valor Nominal**	**Valor Liquidado**
Créditos substituídos no período	0	R$ 0,00	R$ 0,00
Créditos substituídos (analisados)	0	R$ 0,00	R$ 0,00
	Quantidade	**Valor Nominal**	**Valor Aquisição**
Créditos adquiridos no período	24	R$ 4.426.234,59	R$ 4.124.335,78

5.a - A natureza dos direitos creditórios a serem adquiridos e dos instrumentos jurídicos, contratos ou outros documentos representativos do crédito.

Duplicata, NOTA COMERCIAL

5.b – Descrição dos mecanismos e procedimentos de cobrança dos direitos creditórios, inclusive inadimplentes, coleta e pagamento/rateio destas despesas entre os membros do condomínio, caso assim seja determinado pelo regulamento do fundo.

Cobrança extrajudicial ou judicial). No caso de inadimplemento dos Direitos Creditórios Cedidos, ou dos Ativos Financeiros de Liquidez integrantes da carteira da Classe, não há garantia de que a cobrança extrajudicial ou judicial dos valores devidos atingirá os resultados almejados, o que poderá implicar perdas patrimoniais para a Classe e os Cotistas. Ainda, todos os custos incorridos para a cobrança extrajudicial ou judicial dos Direitos Creditórios Cedidos, e dos Ativos Financeiros de Liquidez integrantes da carteira da Classe serão de inteira responsabilidade da Classe e, consequentemente, dos Cotistas, não estando os Prestadores de Serviços Essenciais e os Demais Prestadores de Serviços, de qualquer forma, obrigados pelo adiantamento ou pelo pagamento de tais custos. Os Prestadores de Serviços Essenciais e os Demais Prestadores de Serviços não serão responsáveis por qualquer perda ou

dano sofrido pela Classe ou pelos Cotistas em decorrência da não propositura (ou do não prosseguimento), pela Classe, das medidas extrajudiciais ou judiciais necessárias à cobrança extrajudicial ou judicial dos Direitos Creditórios Cedidos, e dos Ativos Financeiros de Liquidez integrantes da carteira da Classe.

6 – Efeitos das alterações apontadas no Item 5 sobre a rentabilidade da carteira.

Sem inadimplência no período analisado

7.a – Critérios para a concessão de crédito adotados pelos originadores que representem, individualmente, 10% ou mais da carteira do fundo no trimestre.

Não houve alteração no período

7.b – Alterações nos critérios para a concessão de crédito adotados por originadores que representem, individualmente 10% ou mais da carteira do fundo no trimestre.

Considerando que a Classe é destinada exclusivamente a investidores profissionais, a carteira da Classe não está sujeita a qualquer limite de concentração por Devedora, emissor e tipo de Direito de Crédito, conforme facultado pelo art. 52, I, do Anexo Normativo II.
A Classe adquirirá Direitos de Crédito relativos a diferentes segmentos econômicos, em observância às regras e procedimentos estabelecidos por meio deste Regulamento, sem obrigação de investimento ou concentração em nenhum segmento específico. O total de Direitos Creditórios cedidos ao Fundo por um único cedente ou devidos por um único devedor poderão atingir até 100% do Patrimônio Líquido desde que previamente aprovado pelo Comitê de Investimento da Gestora.

8 – Garantias existentes para o conjunto de ativos.

Não há garantias

9.a – Descrição de contratos relevantes firmados na cessão dos direitos creditórios ao fundo.

Concentração acima de 20% de dois cedentes e um sacado

9.b – Indicação do caráter definitivo, ou não, da cessão.

Com e sem coobrigação

10 – Impacto no valor do patrimônio líquido do fundo e na rentabilidade da carteira dos eventos de pré-pagamento.

Durante o período analisado, o Fundo não apresentou pré-pagamentos de diretos creditórios no valor de R$ 0,00, tendo um impacto de R$ 0,00 na carteira do fundo.

11 – Análise do impacto dos eventos de pré-pagamento descrito no Item 10.

.

12 – Condições de alienação, a qualquer título, inclusive por venda ou permuta, de direitos creditórios, incluindo

A qualquer tempo, o Fundo pode alienar a terceiros, e mesmo ao Cedente (recompra), os direitos creditórios integrantes de sua carteira.

13 – Impacto no valor do patrimônio líquido do fundo e na rentabilidade da

carteira de uma possível descontinuidade nas operações de alienação de direitos creditórios realizadas.

.

14 – Análise do impacto da descontinuidade das alienações descrito Item 13.

Durante o período analisado, o Fundo não apresentou descontinuidade de operações em alienação diretos creditórios no valor de R$ 0,00, tendo um impacto de R$ 0,00 na carteira do fundo.

15 – Eventos previstos nos contratos firmados para estruturar a operação que acarretara a amortização antecipada dos direitos creditórios cedidos ao Fundo.

Não ocorreram eventos.

16 – Informações sobre fatos ocorridos que afetaram a regularidade dos fluxos de pagamento previstos.

Não ocorreram eventos.

Atenciosamente,

Catálise Investimentos LTDA.

Rua Dr. Manoel Pedro, 365 – 3° Andar - Cabral Curitiba/PR - CEP 80035-030 | Tel (+55 41) 3014-8444 |
ouvidoria@cataliseinvestimentos.com | cataliseinvestimentos.com