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 CAPITÂNIA YIELD SÊNIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓR, CNPJ/ME Nº 66578726000114, 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/Substituídos:

Não se aplica considerando a natureza do Fundo.

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:

Não se aplica considerando a natureza do Fundo.

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.

ii) 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

RELATÓRIO TRIMESTRAL DO GESTOR – 3º TRIMESTRE DE 2026 – CAPITÂNIA YIELD SÊNIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS RESPONSABILIDADE LIMITADA – 66.578.726/0001-14 – ARTIGO 27, §§ 2º E 3º, DO ANEXO NORMATIVO II À RESOLUÇÃO CVM Nº 175/22

BANCO DAYCOVAL S.A. ("Administradora")

Avenida Paulista, nº 1.793 – Bela Vista, São Paulo/SP

Ref.: Relatório da Gestora, nos termos do artigo 27, §§ 2º e 3º, do Anexo Normativo II à Resolução CVM nº 175/22, referente ao CAPITÂNIA YIELD SÊNIOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS RESPONSABILIDADE LIMITADA – 66.578.726/0001-14 ("Fundo")

Prezados Senhores,

Segue o relatório contendo as informações previstas no artigo 27, §§ 2º e 3º, do Anexo Normativo II à Resolução CVM nº 175/22 e as demais informações que sejam de responsabilidade da Gestora, as quais são necessárias para a elaboração, pela Administradora, do demonstrativo trimestral do Fundo:

§ 2º A informação de que trata a alínea "c" do inciso V do caput:

1. **pode ser dada de forma agregada, caso a quantidade e valores envolvidos nas ações judiciais e arbitrais assim justifiquem;**

   Resposta: Não aplicável.

2. **pode ser omitida do demonstrativo trimestral, a critério do gestor, caso sua divulgação possa prejudicar a estratégia de cobrança ou fomentar a inadimplência de direitos creditórios.**

   Resposta: Não aplicável.

§ 3º Para efeitos da alínea "d" do inciso V do caput, o gestor deve elaborar e encaminhar ao administrador, em até 40 (quarenta) dias após o encerramento do trimestre civil a que se referir, relatório contendo:

1. **os efeitos de eventual alteração na política de investimento sobre a rentabilidade da carteira de ativos;**

   Resposta: Não aplicável.

2. **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;**

      Resposta: Não aplicável.

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;

Resposta: Não aplicável.

3. eventuais alterações nas garantias existentes para o conjunto de direitos creditórios;

Resposta: Não aplicável.

4. forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo:

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

Resposta: Não aplicável.

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

Resposta: Não aplicável.

5. impacto dos eventos de pré-pagamento no valor do patrimônio líquido e na rentabilidade da carteira;

Resposta: Não aplicável.

6. condições de alienação, a qualquer título, de direitos creditórios, incluindo:

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

Resposta: Não aplicável.

b) motivação da alienação;

Resposta: Não aplicável.

7. 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;

Resposta: Não aplicável.

8. 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.

Resposta: Não aplicável.

Atenciosamente,

CAPITANIA CAPITAL S.A.