DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL – 3º TRIMESTRE 2026

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

CNPJ: 62682486000142

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$538.774.223,61	3.810.350	85,21%
Direitos Creditórios Inadimplentes	R$20.826.604,79	78.017	3,29%
Total	R$559.600.828,40	3.888.367	88,51%
PDD	R$9.847.690,02		1,56%

Outros Ativos	R$123.669.838,23		19,56%
Passivo	R$ 7.608.352,50		1,20%
Patrimônio líquido	R$ 632.271.551,44		100,00%

b. Aquisições no trimestre:

Quantidade de Direitos Creditórios	Valor Mercado Atual (R$)
1363287	**R$150.319.845,18**

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$)
59.611	R$15.807.154,63

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	59.611	0	0,00%			R$15.807.154,63
Total	**59.611**	**0**	**0,00%**	**0**	**0**	**R$15.807.154,63**

[1] validamos a documentação comprobatória de recebíveis, que representam a totalidade de direitos creditórios substituídos que permaneceram no estoque até a data-base.
[2] validamos a documentação comprobatória de 30142 recebíveis, que representam a totalidade de 59611 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		
Direitos Creditórios Rejeitados		

Atenciosamente,

Vórtx Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliário Ltda.

MILENIO
CAPITAL

Demonstrativo trimestral – 3º trimestre de 2026

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

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.

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.

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

Em 13-ago o Fundo assinou novo contrato de endosso com novo bancarizador (Vórtx SCD).

Clicksign 4e53c89d-785a-4db6-8a17-358e39759267

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

Caráter 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

Nada a reportar.

b) motivação da alienação;

Nada a reportar.

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

Nada a reportar.

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 4e53c89d-785a-4db6-8a17-358e39759267