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 W CAPITAL II - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, CNPJ/ME Nº 55037275000191, 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	0	0	0
Créditos Inexistentes	0	0	0	0

ii) Direitos Creditórios Substituídos:

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

Não se aplica.

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 há ações ou processos envolvendo a classe com impacto patrimonial identificado na data-base. Percentual do PL em risco: 0,00%.

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

RELATÓRIO TRIMESTRAL DO W CAPITAL II – FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA

CNPJ nº 55.037.275/0001-91

3º TRIMESTRE DE 2026 (1º DE JULHO A 30 DE SETEMBRO DE 2026)

Para fins de cumprimento do disposto no art. 27, inciso V, alíneas "c" e "d", e § 3º, do Anexo Normativo II da Resolução CVM nº 175, a W CAPITAL MANAGEMENT GESTORA DE RECURSOS LTDA., sociedade limitada com sede na Cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Rua Pedroso Alvarenga, 1.254, conjunto 52, Itaim-Bibi, CEP 04531-004, inscrita no CNPJ/MF sob o nº 47.046.216/0001-51, na qualidade de gestora do W CAPITAL II - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS DE RESPONSABILIDADE LIMITADA, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 55.037.275/0001-91 ("Fundo"), apresenta as seguintes informações, referentes ao 3º trimestre de 2026 (1º de julho a 30 de setembro de 2026), ao BANCO DAYCOVAL S.A., instituição financeira com sede na Cidade de São Paulo, Estado de São Paulo, na Avenida Paulista n.º 1.793, inscrito no CNPJ sob o n.º 62.232.889/0001-90, na qualidade de administrador fiduciário do Fundo.

Este relatório é elaborado exclusivamente para atendimento ao art. 27, § 3º, do Anexo Normativo II da Resolução CVM nº 175, com base nas informações disponíveis à Gestora até a presente data, inclusive aquelas fornecidas pela Emissora, garantidoras, prestadores de serviços e demais documentos da operação. Este relatório não constitui auditoria, due diligence independente, opinião legal, garantia de adimplência futura, novação, renúncia de direitos, concordância com eventuais descumprimentos contratuais ou limitação de quaisquer prerrogativas do Fundo, do Administrador ou da Gestora. A Gestora reserva-se o direito de complementar, retificar ou atualizar as informações aqui constantes caso sobrevenham fatos novos ou informações adicionais relevantes.

No trimestre civil em referência, não houve ajuizamento de ação judicial de cobrança, nem propositura de processo administrativo, judicial ou arbitral envolvendo a classe de cotas do Fundo. Dessa forma, não há percentual do patrimônio líquido da classe envolvido e em risco a reportar.

I. OS EFEITOS DE EVENTUAL ALTERAÇÃO NA POLÍTICA DE INVESTIMENTO SOBRE A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE ATIVOS

O FIDC W Capital II foi constituído em maio de 2024 e, desde então, não houve alteração na Política de Investimentos.

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

Não aplicável em sentido estrito no trimestre, tendo em vista que a carteira do Fundo permaneceu concentrada em debêntures privadas de emissão da Leve Saúde Clínica Médica S.A., não tendo havido, no período, aquisição de carteira pulverizada de direitos creditórios originados por terceiros para a qual se aplicasse a identificação de originadores nos termos usuais do dispositivo regulatório.

Sem prejuízo do exposto, a Gestora manteve, no trimestre, os critérios internos de análise, aprovação, monitoramento e acompanhamento do risco de crédito do emissor, sem alteração material.

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 houve qualquer alteração nos critérios para a concessão de crédito.

III. EVENTUAIS ALTERAÇÕES NAS GARANTIAS EXISTENTES PARA O CONJUNTO DE DIREITOS CREDITÓRIOS

Até onde é do conhecimento da Gestora, com base nas informações e documentos disponíveis até a presente data, não houve, no trimestre, alteração dos instrumentos de garantia aplicáveis à operação detida pelo Fundo, permanecendo vigentes os documentos contratuais originalmente celebrados, sem prejuízo do monitoramento contínuo das obrigações e índices contratuais aplicáveis.

IV. FORMA COMO SE OPEROU A CESSÃO DOS DIREITOS CREDITÓRIOS, INCLUINDO

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

Não aplicável em sentido estrito no trimestre, uma vez que não houve cessão de direitos creditórios à carteira do Fundo no período. O ativo detido pelo Fundo permaneceu consubstanciado em debêntures privadas subscritas pelo Fundo, emitidas no âmbito de colocação privada.

Sem prejuízo do exposto, a operação conta com documentos contratuais relevantes de suporte e garantia, incluindo, entre outros, a escritura de emissão das debêntures e os instrumentos de garantia fiduciária celebrados no âmbito da operação.

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

Inexistiu cessão de direitos creditórios à carteira do Fundo no trimestre, razão pela qual este subitem não é aplicável.

V. IMPACTO DOS EVENTOS DE PRÉ-PAGAMENTO NO VALOR DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO E NA RENTABILIDADE DA CARTEIRA;

No trimestre civil em referência, não houve evento de pré-pagamento, amortização extraordinária, amortização antecipada facultativa ou resgate antecipado facultativo do ativo detido pelo Fundo. Em consequência, não houve impacto no patrimônio líquido ou na rentabilidade da carteira decorrente de tais eventos no período.

VI. CONDIÇÕES DE ALIENAÇÃO, A QUALQUER TÍTULO, DE DIREITOS CREDITÓRIOS, INCLUINDO

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

b) motivação da alienação

No trimestre civil em referência, não houve alienação, a qualquer título, dos ativos detidos pelo Fundo. Em consequência, não há momento de alienação nem motivação a reportar no período.

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

Considerando que, no trimestre, a carteira do Fundo permaneceu concentrada em debêntures privadas de emissão da Leve Saúde Clínica Médica S.A., sem aquisição de novos direitos creditórios por cessão, uma eventual descontinuidade da originação ou cessão de direitos creditórios não teria impacto direto imediato sobre a formação da carteira no período reportado.

Sem prejuízo do exposto, tal descontinuidade poderá afetar indiretamente a qualidade, suficiência e regularidade dos fluxos econômicos subjacentes às garantias e à operação, bem como limitar eventual reinvestimento, reciclagem de capital ou diversificação futura da carteira, caso aplicável.

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

No trimestre civil em referência, o agente fiduciário da emissão notificou a Emissora acerca do não atendimento, em determinada data de verificação, do fluxo mínimo de recebíveis em conta vinculada previsto no instrumento de cessão fiduciária. Não houve, no período, inadimplemento de obrigações pecuniárias da Emissora, vencimento antecipado, execução de garantias, liquidação antecipada, amortização extraordinária obrigatória, amortização antecipada facultativa ou resgate antecipado facultativo do ativo detido pelo Fundo.

São Paulo, 12 de novembro de 2026.

_____

W CAPITAL MANAGEMENT GESTORA DE RECURSOS LTDA.

p. Guilherme Waetge