DEMONSTRATIVO TRIMESTRAL
Relatório Trimestral – 30/06/2025

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 FITZ ROY SPECIAL SITUATIONS FIDC DE RESPONSABILIDADE ILIMITADA, CNPJ/ME Nº 45207408000177, disciplinado pela Resolução CMN 2.907, pela Instrução CVM 175 e alterações posteriores, apresenta as informações relativas ao 2º trimestre de 2025:

1. OBJETIVO DO FUNDO E POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A Classe tem como objetivo proporcionar aos Cotistas a valorização das suas Cotas por meio da aplicação de recursos, preponderantemente, nos Direitos Creditórios, observada a política de investimento da Classe.

2. COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

As operações praticadas pelo Fundo no período estiveram em consonância com a política de investimento prevista em seu Regulamento e com os limites de composição e de diversificação a ele aplicáveis.

- Composição da carteira na data base (30/06/2025):

Carteira	Valor	% do PL
Caixa	R$ 1.000,00	0,00%
Contas a Pagar/Receber	R$ -985.816,02	-0,82%
Direito Creditório a vencer	R$ 96.119.259,13	80,61%
Valores Mobiliários	R$ 24.097.998,17	20,21%

3. PROCEDIMENTO DE VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS DIREITOS CREDITÓRIOS

A verificação do lastro dos Direitos Creditórios será feita trimestralmente, de forma individualizada e integral, por meio da verificação do relatório trimestral, observado o Critério de Elegibilidade previsto no Regulamento.
Sem prejuízo de sua responsabilidade, o Custodiante poderá contratar às expensas do Fundo, terceiro para efetuar a guarda dos Documentos Comprobatórios, nos termos da regulamentação aplicável.
Foi utilizada a data base de 30/05/2025.

3.1 DOS RESULTADOS APRESENTADOS

i) Direitos Creditórios a Vencer:

Documentos representativos do lastro:	Analisados	Inconsistências	% Carteira	% PL
CCB	1	-	-	-
Contrato	1	-	-	-
Ação Judicial	1	-	-	-

ii) Direitos Creditórios Vencidos/Substituídos:

O Fundo não possui direitos creditórios vencidos e/ou substituídos no trimestre.

3.2 DOS REGISTROS DE DIREITOS CREDITÓRIOS

i) Direitos Creditórios Registrados:

Direito Creditório	Registrados	% Carteira	% PL
Não aplicável	-	-	-

i) Direitos Creditórios Não Registrados:

Direito Creditório	Não Registrados	% Carteira	% PL
CCB	1	-	-

4. AÇÕES JUDICIAIS, PROCESSOS ADMINISTRATIVOS OU ARBITRAIS

Durante o trimestre em referência, não houve ações judiciais, processos administrativos ou arbitrais.

Atenciosamente,

BANCO DAYCOVAL S.A.
CNPJ 62.232.889/0001-90
Administrador do Fundo

São Paulo, 28 de julho de 2025.

FITZ ROY SPECIAL SITUATIONS FIDC DE RESPONSABILIDADE ILIMITADA
CNPJ: 45.207.408/0001-77

Ao **Banco Daycoval S.A.**
Ref**.:** Informações referentes ao informativo trimestral

Prezados,

Em atenção ao e-mail recebido em 16 de janeiro de 2025 por V.S.as, referente ao cumprimento do Capítulo VI, artigo 27, inciso V, do Anexo Normativo II, da Resolução da Comissão de Valores Mobiliários nº 175, de 23 de dezembro de 2022 ("Resolução CVM 175"), seguem abaixo as informações solicitadas:

I) com relação ao 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 (alínea c do inciso V do artigo 27 do Anexo Normativo II da Resolução CVM 175):

Resposta: Não se aplica. Até presente momento, não há o ajuizamento de ações judiciais de cobrança ou propositura de processo administrativo, judicial ou arbitral envolvendo a classe de cotas. O Fundo é parte em ações judiciais estritamente relacionadas aos direitos creditórios adquiridos, as quais são omitidas nos termos do Art. 27, §2º, inciso II, no Anexo Normativo II, da Resolução CMV nº 175.

II) com relação às informações contidas no relatório trimestral do gestor a que se refere o § 3º do artigo 27, V, do Anexo Normativo II, da Resolução CVM 175(alínea d do inciso V do artigo 27 do Anexo Normativo II da Resolução CVM 175):

Resposta: Vide Relatório do Gestor, nos termos do § 3º do artigo 27, V, do Anexo Normativo II, da Resolução CVM 175 anexo a esta correspondência como Anexo I.

Termos e expressões iniciados em letras maiúsculas, quando utilizados e não definidos de outra forma nesta correspondência, terão o significado que lhes é atribuído no Regulamento.

Atenciosamente,

ANEXO I
RELATÓRIO DO GESTOR DO

FITZ ROY SPECIAL SITUATIONS FIDC DE RESPONSABILIDADE ILIMITADA

CNPJ: 45.207.408/0001-77

(artigo 27, § 3º do Anexo Normativo II da Resolução CVM 175)

[8] de fevereiro de 2025

Nos termos do § 3º do artigo 27, V, do Anexo Normativo II, da Resolução CVM 175, seguem abaixo as informações para efeitos da alínea "d" do inciso V do caput de tal artigo:

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

Não houve alterações na política de investimentos do fundo durante o período em questão.

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;*

Conforme descrito no regulamento do Fundo, aprovado em 30 de setembro de 2024 via consulta formal ("Regulamento"), tendo em vista que os Direitos Creditórios a serem adquiridos pela Classe poderão ser variados e de naturezas distintas, não é possível prever a descrição dos processos de originação ou da política de concessão de crédito adotada pela Gestora quando da seleção dos Direitos Creditórios, sendo realizada única e exclusivamente pela Gestora, conforme os critérios estabelecidos no Regulamento do Fundo por sua política de investimentos.

   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 aplicável, considerando as respostas acima.

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

Houve modificação nas garantias vinculadas a três direitos creditórios integrantes da carteira da classe de cotas do Fundo. Em todos os casos, foi celebrado instrumento de acordo com as respectivas contrapartes, por meio do qual os bens anteriormente gravados com garantia hipotecária e/ou objeto de penhora judicial em favor do Fundo foram objeto de constituição

de alienação fiduciária em garantia, tendo o Fundo como credor fiduciário. Tal alteração visa conferir maior eficiência e celeridade à recuperação do crédito, especialmente em caso de inadimplemento das obrigações pactuadas nos referidos acordos.

IV. *forma como se operou a cessão dos direitos creditórios, incluindo:*
    a. *descrição de contratos relevantes firmados com esse propósito, se houver;*

Todas as cessões de crédito foram realizadas via instrumentos de cessão de crédito para a totalidade dos créditos alvo.

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

Todas as cessões de crédito foram realizadas em caráter definitivo.

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

Não houve nenhum evento de pré-pagamento dos ativos no último trimestre.

VI. *condições de alienação, a qualquer título, de direitos creditórios, incluindo:*
    a. *momento da alienação (antes ou depois do vencimento);*
    b. *motivação da alienação;*

Não houve nenhuma alienação de direitos creditórios no último trimestre.

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*

Não aplicável. Não houve descontinuidade na originação ou cessão de direitos creditórios.

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.*

Não aplicável. A regularidade dos fluxos financeiros oriundos dos direitos creditórios não foi afetada.

******