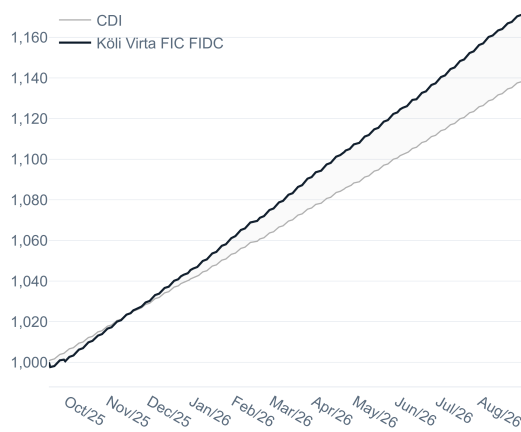


Características do Fundo

Fundo	Köli Virta FIC FIDC	Resgate	D+59 / D+1	Tx Adm	0,12% a.a.	Público-alvo	Investidores Qualificados
CNPJ	61.641.879/0001-45	Aplicação	D+0	Tx Gestão	1,80% a.a.	Mês	+1.28% (117% CDI)
Gestor	Köli Capital	Mov. Min.	R\$ 500,00	Tx Pfee	15% s/ CDI	Ano	+12.02% (129% CDI)
Adm/Custódia	Banco Daycoval	Aplic. Min.	R\$ 1.000,00	PL	R\$ 25.707.761,92	Desde Início	+17.10% (124% CDI)

Evolução da Cota · Comentário da Gestão



Comentário da Gestão

Em agosto de 2026, o Köli Virta FIC FIDC apresentou rentabilidade de +1,28%, equivalente a 117% do CDI (CDI + 2,3% a.a.), em linha com o objetivo de retorno do fundo de CDI + 2% a.a. No acumulado desde o início, o fundo entrega 17,10% (124% do CDI / CDI + 3,06% a.a.). A carteira encerrou o mês com 34 posições em 14 gestoras, com 79% alocados em cotas sêniores e 20% em cotas mezanino.

No mês, o Copom promoveu o quarto corte consecutivo da Selic, para 14,00% a.a., em decisão unânime e sem sinalização para os próximos passos. O IPCA-15 recuou 0,40% e desacelerou para 4,24% em doze meses, mas a curva de juros ganhou inclinação, com fechamento nos vértices curtos e abertura nos longos, sinal de que a taxa terminal deve permanecer em patamar restritivo por bastante tempo. Somado ao elevado comprometimento de renda das famílias (28,9%) e ao avanço da inadimplência no sistema, o cenário sustenta nossa postura conservadora na análise das esteiras de crédito. Vale notar que o crédito livre às pessoas jurídicas recuou 1,9% no mês, com retração em desconto de duplicatas e outros recebíveis, o que amplia o espaço de originação dos FIDCs e reforça a necessidade de seletividade nas aprovações.

Conforme nossa estratégia, não realizamos novas alocações em agosto, mês em que recebemos amortizações de algumas posições. As métricas da carteira de FIDCs (referentes a julho/26) seguem saudáveis: a PDD média (ex-fundos de crédito massificado, NPL e special situations) ficou em 5,52%, praticamente estável, com subordinação ponderada de 39,6% e prazo médio de 117 dias. Os vencidos acima de 30 dias subiram de 6,00% para 6,91%, movimento que seguimos monitorando de perto. Seguimos focados na estratégia multicedente-multisacado, que hoje representa 76,01% do PL do fundo.

Rentabilidade Histórica

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acum.
2026	Fundo	1.50%	1.30%	1.58%	1.40%	1.36%	1.41%	1.59%	1.28%	–	–	–	–	12.02%	17.10%
	CDI	1.16%	1.00%	1.21%	1.09%	1.07%	1.12%	1.22%	1.09%	–	–	–	–	9.32%	13.81%
	%CDI	129%	131%	130%	129%	126%	126%	131%	117%	–	–	–	–	129%	124%
	Fundo	–	–	–	–	–	–	–	–	0.05%	1.61%	1.27%	1.55%	4.54%	4.54%
2025	CDI	–	–	–	–	–	–	–	–	0.50%	1.28%	1.05%	1.22%	4.11%	4.11%
	%CDI	–	–	–	–	–	–	–	–	10%	126%	120%	127%	111%	111%

Mês parcial em set/25 (início 18/09). CDI: taxas diárias reais BCB SGS série 12.

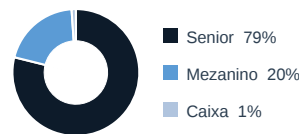
Diversificação da Carteira

Por Segmento	Por Cota Sênior	Por Cota Mezanino	Por Originador
Middle Market	Fundo 1 66.0%	Fundo 1 4.5%	Originador 1 18.5%
Agropecuária	Fundo 2 14.4%	Fundo 2 3.2%	Originador 2 16.9%
Outros	Fundo 3 8.1%	Fundo 3 2.4%	Originador 3 12.9%
Imobiliário	Fundo 4 5.3%	Fundo 4 2.2%	Originador 4 8.8%
Precatórios	Fundo 5 5.1%	Fundo 5 2.2%	Originador 5 8.5%
Risco Sacado Varejo	Fundo 6 3.1%	Fundo 6 1.2%	Originador 6 5.1%
Crédito Massificado	Fundo 7 2.9%	Fundo 7 1.2%	Originador 7 4.2%
	Fundo 8 2.4%	Fundo 8 1.2%	Originador 8 3.2%
	Outros 23.5%	Outros 1.9%	Outros 21.9%

Indicadores Consolidados

Subord. Pond.	PDD Médio Pond.	Vencidos >30d Pond.	Prazo Médio Pond.	Recompra Méd. Pond.
39.6%	5.52%	6.91%	117 dias	1.0%
Posições	Gestoras	Top 5 Posições	Top 10 Posições	Maior Posição
34	14	47.0%	63.0%	14.4%

Composição por Estratégia



Este informe não configura uma oferta de venda do fundo mencionado, leia com atenção o formulário de informações complementares, lâmina de informações essenciais e o regulamento antes de investir. Rentabilidades passadas não representam garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada acima não é líquida de imposto. Os indicadores econômicos são meras referências e não metas ou parâmetros de performance. Fundos de investimentos não contam com garantia do administrador, do gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou Fundo de Garantia de Crédito – FGC. Os fundos utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Os fundos podem estar expostos à relevante concentração de ativos financeiros de poucos emissores, com os riscos recorrentes destes. A análise da performance do fundo de investimento é recomendada a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses.