



Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Responsabilidade Limitada

(CNPJ nº 52.805.381/0001-80)
(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)
Demonstrações contábeis em
31 de março de 2026
e relatório do auditor independente



Relatório do auditor independente sobre as demonstrações contábeis

Aos Cotistas e ao Administrador
Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado
Responsabilidade Limitada
(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

Opinião

Examinamos as demonstrações contábeis da Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Responsabilidade Limitada ("Classe"), que compreendem o demonstrativo da composição e diversificação da carteira em 31 de março de 2026 e a demonstração da evolução do patrimônio líquido para o exercício findo nessa data, bem como as correspondentes notas explicativas, incluindo as políticas contábeis materiais e outras informações elucidativas.

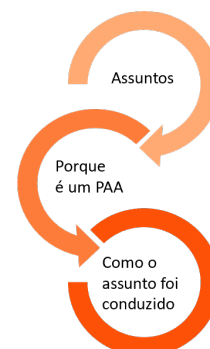
Em nossa opinião, as demonstrações contábeis acima referidas apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira da Classe em 31 de março de 2026 e o desempenho de suas operações para o exercício findo nessa data, de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de investimento financeiro.

Base para opinião

Nossa auditoria foi conduzida de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria. Nossas responsabilidades, em conformidade com tais normas, estão descritas na seção intitulada "Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações contábeis". Somos independentes em relação à Classe, de acordo com os princípios éticos relevantes previstos no Código de Ética Profissional do Contador e nas normas profissionais emitidas pelo Conselho Federal de Contabilidade, aplicáveis a auditorias de demonstrações contábeis de entidades de interesse público no Brasil, e cumprimos com as demais responsabilidades éticas conforme essas normas. Acreditamos que a evidência de auditoria obtida é suficiente e apropriada para fundamentar nossa opinião.

Principais Assuntos de Auditoria

Principais Assuntos de Auditoria (PAA) são aqueles que, em nosso julgamento profissional, foram os mais significativos em nossa auditoria do exercício corrente. Esses assuntos foram tratados no contexto de nossa auditoria das demonstrações contábeis como um todo e na formação de nossa opinião sobre essas demonstrações contábeis e, portanto, não expressamos uma opinião separada sobre esses assuntos.



Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Responsabilidade Limitada

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

Porque é um PAA	Como o assunto foi conduzido em nossa auditoria
Existência e mensuração dos investimentos	
Conforme apresentado no demonstrativo da composição e diversificação da carteira, os recursos do Fundo estão investidos, substancialmente, em cotas de fundos de investimento e títulos privados. Esses títulos privados estão classificados na categoria de títulos para negociação.	Nossos principais procedimentos de auditoria consideraram, entre outros:
As aplicações em cotas de fundos são mensuradas considerando os valores das cotas disponibilizados pelos administradores dos fundos investidos. O administrador do Fundo utiliza os extratos dos fundos investidos para confirmação da existência das aplicações em cotas de fundos.	Obtivemos entendimento dos principais processos relacionados à existência e precificação dos investimentos do Fundo.
A existência dos títulos privados é assegurada por meio de conciliações com as informações do órgão custodiante.	Testamos a existência dos investimentos em cotas de fundos de investimento por meio do confronto das informações constantes na carteira do Fundo com informações disponibilizadas pelos administradores dos fundos investidos.
A precificação dos investimentos em títulos privados, classificados na categoria de negociação é obtida por cotação de mercado. Na ausência de mercado ativo, os títulos privados são precificados com base em metodologia interna desenvolvida pelo administrador do Fundo que considera dados observáveis de mercado e risco de crédito do emissor.	Efetuamos testes quanto a existência dos investimentos em títulos privados por meio do confronto das informações disponíveis na composição e diversificação das aplicações do Fundo com as informações do órgão custodiante.
Considerando a relevância desses investimentos em relação ao patrimônio líquido do Fundo e a consequente apuração do valor de sua cota, a existência e a precificação desses investimentos foram consideradas áreas de foco em nossa auditoria.	Confrontamos os valores utilizados para a precificação dos títulos privados, classificados na categoria para negociação, com os preços de cotação de mercado, na ausência de mercado ativo, testamos a precificação dos títulos privados tendo como base a metodologia interna desenvolvida pelo custodiante que considera as premissas observáveis de mercado e o risco de crédito do emissor, definidos pelo administrador do Fundo.
	Realizamos o confronto dos valores utilizados para precificação dos investimentos em cotas de fundos de investimento com os valores das cotas disponibilizados pelos administradores dos fundos investidos.
	Adicionalmente, obtivemos os relatórios de auditoria sobre as demonstrações contábeis mais recentes dos fundos investidos e, quando considerado apropriado, também dos fundos investidos por esses fundos. Com base nessas informações, analisamos se há modificação



Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Responsabilidade Limitada

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

nos relatórios dos auditores ou informações relevantes com impacto nas demonstrações contábeis do Fundo.

Consideramos que os critérios e as premissas adotadas pela administração quanto à existência e precificação desses investimentos são consistentes com as informações analisadas em nossa auditoria.

Responsabilidades da administração e da governança pelas demonstrações contábeis

A administração da Classe é responsável pela elaboração e adequada apresentação das demonstrações contábeis de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil, aplicáveis aos fundos de investimento financeiro e pelos controles internos que ela determinou como necessários para permitir a elaboração de demonstrações contábeis livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro.

Na elaboração das demonstrações contábeis, a administração é responsável pela avaliação da capacidade da Classe continuar operando, divulgando, quando aplicável, os assuntos relacionados com a sua continuidade operacional e o uso dessa base contábil na elaboração das demonstrações contábeis. A continuidade das operações de uma classe de investimento é, adicionalmente, dependente da prerrogativa dos cotistas em resgatar suas cotas nos termos do regulamento da Classe.

Os responsáveis pela governança da Classe são aqueles com responsabilidade pela supervisão do processo de elaboração das demonstrações contábeis.

Responsabilidades do auditor pela auditoria das demonstrações contábeis

Nossos objetivos são obter segurança razoável de que as demonstrações contábeis, tomadas em conjunto, estão livres de distorção relevante, independentemente se causada por fraude ou erro, e emitir relatório de auditoria contendo nossa opinião. Segurança razoável é um alto nível de segurança, mas não uma garantia de que a auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria sempre detectam as eventuais distorções relevantes existentes. As distorções podem ser decorrentes de fraude ou erro e são consideradas relevantes quando, individualmente ou em conjunto, possam influenciar, dentro de uma perspectiva razoável, as decisões econômicas dos usuários tomadas com base nas referidas demonstrações contábeis.

Como parte de uma auditoria realizada de acordo com as normas brasileiras e internacionais de auditoria, exercemos julgamento profissional e mantemos ceticismo profissional ao longo da auditoria. Além disso:

Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Responsabilidade Limitada

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

- Identificamos e avaliamos os riscos de distorção relevante nas demonstrações contábeis, independentemente se causada por fraude ou erro, planejamos e executamos procedimentos de auditoria em resposta a tais riscos, bem como obtemos evidência de auditoria apropriada e suficiente para fundamentar nossa opinião. O risco de não detecção de distorção relevante resultante de fraude é maior do que o proveniente de erro, já que a fraude pode envolver o ato de burlar os controles internos, conluio, falsificação, omissão ou representações falsas intencionais.
- Obtemos entendimento dos controles internos relevantes para a auditoria para planejarmos procedimentos de auditoria apropriados às circunstâncias, mas, não, com o objetivo de expressarmos opinião sobre a eficácia dos controles internos da Classe.
- Avaliamos a adequação das políticas contábeis utilizadas e a razoabilidade das estimativas contábeis e respectivas divulgações feitas pela administração.
- Concluimos sobre a adequação do uso, pela administração, da base contábil de continuidade operacional e, com base nas evidências de auditoria obtidas, se existe incerteza relevante em relação a eventos ou condições que possam levantar dúvida significativa em relação à capacidade de continuidade operacional da Classe. Se concluirmos que existe incerteza relevante, devemos chamar atenção em nosso relatório de auditoria para as respectivas divulgações nas demonstrações contábeis ou incluir modificação em nossa opinião, se as divulgações forem inadequadas. Nossas conclusões estão fundamentadas nas evidências de auditoria obtidas até a data de nosso relatório. Todavia, eventos ou condições futuras podem levar a Classe a não mais se manter em continuidade operacional.
- Avaliamos a apresentação geral, a estrutura e o conteúdo das demonstrações contábeis, inclusive as divulgações, e se essas demonstrações contábeis representam as correspondentes transações e os eventos de maneira compatível com o objetivo de apresentação adequada.

Comunicamo-nos com os responsáveis pela governança a respeito, entre outros aspectos, do alcance e da época dos trabalhos de auditoria planejados e das constatações significativas de auditoria, inclusive as deficiências significativas nos controles internos que, eventualmente, tenham sido identificadas durante nossos trabalhos.



Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Responsabilidade Limitada

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

Dos assuntos que foram objeto de comunicação com os responsáveis pela governança, determinamos aqueles que foram considerados como mais significativos na auditoria das demonstrações contábeis do exercício corrente e que, dessa maneira, constituem os Principais Assuntos de Auditoria. Descrevemos esses assuntos em nosso relatório de auditoria, a menos que lei ou regulamento tenha proibido divulgação pública do assunto, ou quando, em circunstâncias extremamente raras, determinarmos que o assunto não deve ser comunicado em nosso relatório porque as consequências adversas de tal comunicação podem, dentro de uma perspectiva razoável, superar os benefícios da comunicação para o interesse público.

São Paulo, 29 de junho de 2026

A handwritten signature in grey ink that reads 'PricewaterhouseCoopers'.

PricewaterhouseCoopers
Auditores Independentes Ltda.
CRC 2SP000160/O-5

Marcelo Luis Teixeira Santos
Contador CRC 1PRO50377/O-6

Demonstrativo da composição e diversificação da carteira em 31 de março de 2026
(Em milhares de reais - R\$)

Aplicações/especificações	Espécie/ forma	Quantidade	Custo total	Mercado / Realização	% sobre o patrimônio líquido
Disponibilidades				1	-
Depósitos bancários (*)				1	-
Títulos e valores mobiliários			62.850	151.024	100,04
Títulos Públicos			14.829	13.935	9,23
Letras Financeiras do Tesouro	LFT	796	14.829	13.935	9,23
Vinculados a prestação de garantias				914	0,61
Letras Financeiras do Tesouro	LFT			914	0,61
Cotas de fundos de investimento				88.845	58,85
Daycoval Títulos Públicos II F.I.R.F.	Cotas	15.382		27.597	18,28
Daycoval Títulos Públicos I F.I.R.F.	Cotas	15.364		27.597	18,28
Daycoval Títulos Públicos IV F.I.R.F.	Cotas	15.815.216		27.596	18,28
FIDC Gcb Crédito Multiestratégia Responsabilidade Limitada	Cotas	6.045		6.055	4,01
Certificado de recebíveis imobiliários			20.235	19.485	12,91
GCB Securitizadora II S.A.	CRI	1.886.941	19.448	18.981	12,57
Gran Vellas Wind Empreendimentos SPE Ltda.	CRI	52.394	787	504	0,34
Notas de crédito			17.675	17.708	11,73
GCB Securitizadora SPE Ltda.	NC	14.289.241	15.039	15.039	9,96
Gran Vellas Wind Empreendimentos SPE Ltda.	NC	2.000	1.538	1.571	1,04
Vilas do Palácio Empreendimento Imobiliário SPE	NC	1.000	1.098	1.098	0,73
Debêntures			6.720	6.720	4,45
GCB Securitizadora II S.A.	Deb.	6.217.320	6.720	6.720	4,45
Certificado de recebíveis do agronegócio			3.391	3.417	2,26
GCB Securitizadora II S.A.	CRA	343.613	3.391	3.417	2,26
Outros créditos				174	0,11
Negociações e intermediações de valores				107	0,07
Dividendos e bonificações a receber				67	0,04
Total do ativo				151.199	100,15
Outras obrigações				243	0,15
Taxa de performance (*)				123	0,08
Taxa de gestão (*)				50	0,03
Credores conta liquidações pendentes				36	0,02
Serviços de auditoria				10	0,01
Taxa de administração (*)				9	0,01
Taxa de rebate				6	-
Taxa CVM				5	-
Taxa de custódia (*)				4	-
Patrimônio líquido				150.956	100,00
Total do passivo e do patrimônio líquido				151.199	100,15

(*) Transações com partes relacionadas

As notas explicativas são parte integrante das demonstrações contábeis.

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)
CNPJ: 62.232.889/0001-90

Demonstração da evolução do patrimônio líquido
Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025
(Em milhares de reais - R\$, exceto o valor unitário das cotas)

			31/03/2026	31/03/2025
Patrimônio líquido no início do exercício				
Representado por	61.310,4437 cotas a	R\$104,5641 cada uma	6.411	-
Representado por	35.100,5707 cotas a	R\$101,5788 cada uma	-	3.565
Cotas emitidas				
	1.270.668,0282 cotas		144.959	-
	30.775,8174 cotas		-	3.148
Cotas resgatadas				
	63.141,6991 cotas		(7.955)	-
	4.565,9444 cotas		-	(749)
Variação no resgate/amortização de cotas			882	278
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício			144.297	6.242
Resultado do exercício				
A - Ações e Cotas de Fundos				
	Valorização/desvalorização a valor justo		(23)	
	Dividendos e juros sobre capital próprio		3	5
	Resultado de aplicações em cotas de fundos de investimento		3.752	374
Total			3.732	379
B - Renda fixa e outros títulos e valores mobiliários				
	Apropriação de rendimentos		4.341	98
	Valorização/desvalorização a valor justo		(993)	1
	Resultado nas negociações		(12)	
Total			3.336	99
C - Demais receitas				
	Ganhos com Derivativos		2.410	24.492
	Receitas diversas		73	19
Total			2.483	24.511
D - Demais despesas				
	Perdas com derivativos		(2.412)	(24.707)
	Taxa de Performance		(154)	(1)
	Taxa de Gestão		(145)	(39)
	Despesas diversas		(79)	(7)
	Taxa de Administração		(50)	(29)
	Auditoria e custódia		(20)	(22)
	Despesa de controladoria		(20)	(12)
	Taxa de fiscalização - CVM		(12)	(3)
Total			(2.892)	(24.820)
Resultado do exercício			6.659	169
Patrimônio líquido no fim do exercício				
Representado por	1.268.836,7728 cotas a	R\$118,9723 cada uma	150.956	
Representado por	61.310,4437 cotas a	R\$104,5641 cada uma		6.411
As notas explicativas são parte integrante das demonstrações contábeis.				

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

1. Contexto operacional

O GCB Renda Fixa 30 Crédito Privado Fundo de Investimento Financeiro (“Fundo”) foi constituído em 03 de novembro de 2023 e iniciou suas atividades em 12 de dezembro de 2023, sob a forma de condomínio de natureza especial, com prazo indeterminado de duração. Destinado a receber aplicações de investidores qualificados. O Fundo é composto por classe única de cotas e poderá ter subclasses a critério do Administrador.

A Classe GCB Renda Fixa 30 Fundo de Investimento Renda Fixa Crédito Privado Responsabilidade Limitada (“Classe”) será regida pelo Anexo ao regulamento do Fundo e pelas disposições legais e regulamentares que lhe forem aplicáveis, em especial pela Resolução CVM 175/22. A Classe foi constituída em regime aberto, com prazo indeterminado de duração, e tipificada como “renda fixa”. Possui responsabilidade limitada dos cotistas ao valor por eles subscrito e/ou integralizado e é destinada a investidores qualificados.

A Classe tem como objetivo de investimento buscar proporcionar a valorização de suas cotas no longo prazo, preponderantemente, por meio de aplicações de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa disponíveis nos mercados financeiro e de capitais em geral.

As aplicações realizadas na Classe não contam com a garantia do Administrador, do Gestor(a), de qualquer empresa pertencente ao seu conglomerado financeiro, e tampouco de qualquer mecanismo de seguro ou do Fundo Garantidor de Créditos – FGC

A administração da carteira da Classe é realizada pelo Banco Daycoval S.A. (“Administrador”) e a gestão da carteira é realizada pela GCB Capital Gestão de Recursos de Valores Mobiliários Ltda. (“Gestora”).

2. Apresentação e elaboração das demonstrações contábeis

As demonstrações contábeis foram elaboradas e estão sendo apresentadas de acordo com as práticas contábeis adotadas no Brasil aplicáveis aos Fundos de Investimento Financeiro, previstas no Plano Contábil dos Fundos de Investimento - COFI e demais orientações emanadas da Comissão de Valores Mobiliários - CVM, especialmente pela Resolução CVM nº 175/22 e alterações posteriores.

No exercício em curso, o Administrador do Fundo procedeu com a adaptação da Resolução CVM nº 175/22 em substituição à Instrução CVM nº 555/14. Tais alterações não produziram impactos no patrimônio líquido do Fundo.

Na elaboração dessas demonstrações contábeis foram utilizadas premissas e estimativas de preços para a contabilização e determinação dos valores dos ativos e instrumentos financeiros integrantes da carteira da Classe. Desta forma, quando da efetiva liquidação financeira desses ativos e instrumentos financeiros, os resultados auferidos poderão ser diferentes dos estimados.

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

Essas demonstrações contábeis, foram aprovadas pelo Administrador do Fundo em 29 de junho de 2026 que autorizou sua divulgação.

3. Principais práticas contábeis

As principais práticas contábeis adotadas para a contabilização das operações e para a elaboração das demonstrações contábeis decorrem das normas da CVM e, dentre essas práticas, destacam-se as seguintes:

a) Reconhecimento de receitas e despesas

O Administrador adota o regime de competência para o registro das receitas e despesas.

b) Aplicações interfinanceiras de liquidez

São demonstradas pelo valor de aplicação, acrescido dos rendimentos auferidos.

c) Títulos e valores mobiliários

De acordo com o estabelecido pela Instrução CVM nº 577/16, os títulos e valores mobiliários são classificados em duas categorias específicas de acordo com a intenção de negociação, atendendo aos seguintes critérios para contabilização:

- (i) Títulos para negociação** - Incluem os títulos e valores mobiliários adquiridos com o objetivo de serem negociados frequentemente e de forma ativa, sendo contabilizados pelo valor justo, em que as perdas e os ganhos realizados e não realizados sobre esses títulos são reconhecidos no resultado; e
- (ii) Títulos mantidos até o vencimento** - Incluem os títulos e valores mobiliários, exceto ações não resgatáveis, para os quais haja a intenção e a capacidade financeira para mantê-los até o vencimento, sendo contabilizados ao custo de aquisição, acrescidos dos rendimentos intrínsecos, desde que observadas as seguintes condições:
 - A Classe de investimento seja destinada a um único investidor, a investidores pertencentes ao mesmo conglomerado ou grupo econômico-financeiro ou fundos de investimento fechados exclusivamente destinados a investidores qualificados, esses últimos definidos como tal pela regulamentação editada pela CVM relativamente às categorias de investidores dos fundos de investimento;
 - Haja declaração formal de todos os cotistas, devendo constar que possuem capacidade financeira para levar ao vencimento os ativos classificados nesta categoria; e
 - Todos os cotistas que ingressarem na classe a partir da classificação nesta categoria declarem formalmente, por meio do termo de adesão ao regulamento do mesmo, sua capacidade

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

financeira e anuência à classificação de títulos e valores mobiliários integrantes da carteira da Classe na categoria mencionada neste item.

Caso a Classe de Investimento invista em cotas de outro fundo de investimento, que classifique os títulos e valores mobiliários da sua carteira na categoria de títulos mantidos até o vencimento, é necessário que sejam atendidas, pelos cotistas da Classe investidora, as mesmas condições acima mencionadas.

A Classe não possui títulos classificados na categoria de mantidos até o vencimento em 31 de março de 2026.

(iii) Cotas de fundos de investimento

As valorizações e as desvalorizações dos investimentos em cotas de fundos de investimento estão apresentadas na demonstração da evolução do patrimônio líquido em “Resultado de aplicações em cotas de fundos de investimento”.

(iv) Títulos públicos e privados

Os títulos públicos e privados integrantes da carteira são contabilizados pelo custo de aquisição, acrescido diariamente dos rendimentos incorridos (curva) até a data do balanço, e ajustados ao valor justo, quando aplicável, em função da classificação dos títulos prevista na Instrução CVM n.º 577/16.

d) Instrumentos Financeiros Derivativos

Mercado futuro

As receitas e despesas provenientes dos ajustes a receber e a pagar nas operações de mercado futuro, são registradas diariamente, nas rubricas “Ganhos/perdas com derivativos”.

e) Valor justo de títulos e valores mobiliários e instrumentos financeiros derivativos:

i. Os critérios utilizados para apuração do valor justo de títulos e valores mobiliários são os seguintes:

- **Pós-fixados:** pelo método de fluxo de caixa descontado. As taxas de desconto utilizadas são projeções divulgadas por boletins ou publicações especializadas pela ANBIMA (Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiros e de Capitais);
- **Prefixados:** pelo método de fluxo de caixa descontado. As taxas de desconto utilizadas são projeções de taxas de juros/swap divulgadas pela B3 S.A. – Brasil, Bolsa, Balcão, ANBIMA e por outras fontes de informação;

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

- **Cotas de Fundos de Investimento:** os investimentos em cotas de fundos de investimento são registrados por seus custos de aquisição e atualizados, diariamente, pelo valor da última cota divulgada por seus respectivos administradores;

ii. Os critérios utilizados para apuração do valor justo instrumentos financeiros derivativos são os seguintes:

- **Operações no mercado futuro:** cotações divulgadas pela B3 S.A.;

4. Títulos e valores mobiliários

O montante, a natureza, os prazos de vencimento, os valores de custo amortizado e o valor justo dos títulos e valores mobiliários classificados como títulos para negociação, em 31 de março de 2026, estão demonstrados abaixo:

Títulos para negociação	Natureza	Custo atualizado	Valor Justo	Vencimento		
				Sem vencimento	Até 365 dias	Acima de 365 dias
Debêntures	Privada	6.720	6.720	-	-	6.720
Nota de crédito	Privada	17.675	17.708	-	-	17.708
Certificado de recebíveis do agronegócio	Privada	3.391	3.417	-	-	3.417
Certificado de Recebíveis Imobiliários	Privada	20.235	19.485	-	-	19.485
Letras Financeiras do Tesouro	Pública	14.829	14.849	-	243	14.606
Total		62.850	62.179	-	243	61.936

A Classe mantém também em sua carteira cotas de fundos de investimento no montante de R\$ 88.845, classificadas como títulos para negociação, sem prazo de vencimento.

5. Instrumentos financeiros derivativos

É vedado à Classe a realização de operações com derivativos, exceto quando tais operações sejam realizadas exclusivamente para fins de proteção patrimonial.

- a) Durante os exercícios findos em 31 de março de 2026 e de 2025, as operações com instrumentos financeiros derivativos geraram ganhos/perdas, os quais são apresentados a seguir:

Derivativos	2026			2025		
	Ganhos	Perdas	Resultado líquido	Ganhos	Perdas	Resultado líquido
Futuros	2.410	(2.412)	(2)	24.492	(24.707)	(215)
Total	2.410	(2.412)	(2)	24.492	(24.707)	(215)

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

b) Títulos dados em garantia

O quadro, a seguir, resume os valores e as garantias oferecidas para os instrumentos financeiros derivativos em 31 de março de 2026:

Títulos públicos federais acima de 1 ano	Valor	Vínculo
Letras Financeiras do Tesouro	914	B3 S.A.

6. Gerenciamento de riscos

a) Dentre os fatores de risco aos quais o Fundo está sujeito, incluem-se, sem limitação:

Risco de mercado: Os valores dos ativos financeiros e derivativos integrantes da carteira da Classe e/ou dos fundos investidos são suscetíveis às oscilações decorrentes das flutuações de preços e cotações de mercado, bem como das taxas de juros e dos resultados de seus emissores. Nos casos em que houver queda do valor destes ativos, o patrimônio líquido do Fundo poderá ser afetado negativamente.

Risco de crédito: Consiste no risco de os emissores dos ativos financeiros e/ou das contrapartes das transações do Fundo e/ou dos fundos investidos não cumprirem suas obrigações de pagamento (principal e juros) e/ou de liquidação das operações contratadas. Ocorrendo tais hipóteses, o patrimônio líquido do Fundo poderá ser afetado negativamente.

Risco de liquidez: Caracteriza-se pela possibilidade de redução ou mesmo inexistência de demanda pelos ativos financeiros integrantes da carteira da Classe e/ou dos fundos investidos, nos respectivos mercados em que são negociados. Em virtude de tais riscos, o gestor poderá encontrar dificuldades para liquidar posições ou negociar tais ativos financeiros no tempo e pelo preço desejados, podendo, inclusive, ser obrigado a aceitar descontos nos preços de forma a viabilizar a negociação e, em casos excepcionais de iliquidez, efetuar resgates de cotas, total ou parcialmente, fora dos prazos estabelecidos no regulamento do Fundo, inclusive em virtude de atraso no pagamento de resgate de cotas e/ou divulgação de valores de cotas pelos fundos investidos.

Risco de investimento em renda variável: o mercado de bolsa de valores é considerado um mercado de alto risco devido às grandes variações de rendimentos a que está sujeito. Adicionalmente, os investimentos em ações estão sujeitos a riscos de perda de parte do capital investido em razão de degeneração da situação econômico-financeira da empresa emissora das ações.

Risco decorrente do investimento no mercado externo: Fundo poderá manter em sua carteira ativos financeiros negociados no exterior e, conseqüentemente, a performance do Fundo pode ser afetada por requisitos legais ou regulatórios, por exigências tributárias relativas a todos os países nos quais ele invista ou, ainda, pela variação do Real em relação a outras moedas. Os investimentos do Fundo estarão expostos a alterações nas condições políticas, econômica ou

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

social nos países onde investem, o que pode afetar negativamente o valor de seus ativos. Podem ocorrer atrasos na transferência de juros, dividendos, ganhos de capital ou principal, entre países onde o Fundo invista e o Brasil, o que pode interferir na liquidez e no desempenho do Fundo. As operações do Fundo poderão ser executadas em bolsas de valores, de mercadoria e futuros ou registradas em sistema de registro, de custódia ou de liquidação financeira de diferentes países que, podem estar sujeitos a distintos níveis de regulamentação e supervisionados por autoridades locais reconhecidas, entretanto não existem garantias da integridade das transações e nem, tampouco, sobre a igualdade de condições de acesso aos mercados locais.

Risco de Concentração: A concentração de investimentos da Classe de Cotas e/ou das Classes de Cotas Investidas em um mesmo ativo financeiro pode potencializar a exposição da carteira aos riscos aqui mencionados. De acordo com a política de investimento, a Classe de Cotas pode estar, ainda, exposto a significativa concentração em ativos financeiros de poucos ou de um mesmo emissor, com os riscos daí decorrentes.

Risco de Perdas Patrimoniais: Os Fundos Investidos utilizam estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus Cotistas, inclusive com derivativos caso a Composição da Carteira indicada neste Regulamento permita.

Risco Decorrente da Precificação dos Ativos Financeiros: A precificação dos ativos financeiros integrantes da carteira da Classe de Cotas e/ou das Classes de Cotas investidas é realizada de acordo com os critérios e procedimentos estabelecidos na regulamentação em vigor. Referidos critérios, tais como os de marcação a mercado, poderão ocasionar variações nos valores dos ativos financeiros integrantes da carteira da Classe de Cotas e/ou das Classes de Cotas investidas, resultando em aumento ou redução no valor das cotas da Classe de Cotas.

Risco Regulatório: as eventuais alterações nas normas ou leis aplicáveis ao FUNDO e suas Classes de Cotas, incluindo, mas não se limitando àquelas referentes a tributos, podem causar um efeito adverso relevante no preço dos ativos e/ou na performance das posições financeiras adquiridas pelas Classes de Cotas. Da mesma forma, caso tais normas ou leis aplicáveis ao FUNDO e suas Classes de Cotas venham a sofrer qualquer alteração, os investimentos nas respectivas Classes de Cotas poderão acarretar eventual desenquadramento dos Cotistas aos eventuais limites aplicáveis a eles, sem qualquer responsabilidade do ADMINISTRADOR;

Risco da desconsideração da responsabilidade limitada pelo Poder Judiciário: A legislação vigente trouxe para a indústria de Fundos de investimentos a possibilidade de existência de Classes de Cotas com responsabilidade limitada ao valor das cotas. Como se trata de um instituto novo para a indústria de Fundos, caso haja alguma disputa judicial, não há como garantir que a responsabilidade limitada do cotista será respeitada.

Limitação da responsabilização dos prestadores de serviços do FUNDO e de suas Classes de Cotas: A legislação vigente trouxe para a indústria de Fundos de investimento a responsabilização individual dos prestadores de serviços do Fundo e de suas Classes de Cotas. Sendo assim, os prestadores de serviços do Fundo e de suas Classes de Cotas não são solidários entre si. Eles

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

respondem individualmente por seus atos e omissões, de acordo com suas respectivas esferas de competência, dispostas no Regulamento, na legislação vigente e nos contratos de prestação de serviços celebrados entre as partes. Desta forma, para fins de reparação civil, a responsabilidade que recai sobre os prestadores de serviços do Fundo e suas Classes de Cotas restringe-se aos seus atos e omissões relativos aos serviços prestados, nos termos do Regulamento, da legislação vigente e nos contratos de prestação de serviços, de modo que não há responsabilidade solidária de tais prestadores de serviços perante o Fundo.

A íntegra dos fatores de risco atualizados a que o Fundo e os cotistas estão sujeitos encontra-se descrita no regulamento do Fundo, devendo os cotistas e os potenciais investidores ler atentamente o referido documento.

Os riscos acima mencionados poderão afetar o patrimônio da Classe, sendo que o Administrador e a Gestora não poderão, em hipótese alguma, ser responsabilizados por qualquer resultado negativo na rentabilidade do Fundo, depreciação dos ativos financeiros integrantes da carteira ou por eventuais prejuízos em caso de liquidação do Fundo ou resgate de cotas, sendo os mesmos responsáveis tão somente por perdas ou prejuízos resultantes de comprovado erro ou má-fé de sua parte.

b) Política de administração de risco

O Administrador mantém um sistema de gerenciamento de riscos baseado em modelos matemáticos e estatísticos aplicados à carteira diariamente, com o objetivo de garantir que o Fundo esteja exposto apenas aos riscos inerentes à sua política de investimentos e de acordo com os critérios de risco estabelecidos no regulamento do Fundo. Ainda assim, não há garantia de completa eliminação da possibilidade de perdas para o Fundo e para o investidor.

Os principais modelos são:

- **V@R (Value at Risk)** – estima, a partir de séries temporais e variáveis estatísticas, a perda financeira máxima para um dia.
- **Stress Testing** – simula perda financeira num cenário econômico financeiro crítico utilizando expressivas variações dos preços dos ativos e derivativos da carteira.

Este procedimento é realizado diariamente pelo Administrador, mediante a utilização de sistema automático.

c) Análise de sensibilidade

Metodologia

O VaR (*Value at Risk*) é a matéria de risco que informa a perda financeira esperada considerando um horizonte de tempo e um intervalo de confiança determinado. Para cálculo do VaR, foi adotado o modelo paramétrico com horizonte de tempo de 21 dias e intervalo de confiança de

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

95% e para cálculo das volatilidades foi utilizada a metodologia EWMA (*Exponentially Weighted Moving Average*), com fator de decaimento exponencial (λ) de 0,94.

Data de Referência	31/03/2026
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	150.956
VaR (Valor em Risco) em %	0,6552%

O método tem como objetivo proporcionar ao investidor uma estimativa da potencial perda de uma carteira em função do histórico de preços. Como limitação, por assumir normalidade dos dados e, em geral, intervalo de confiança de 95% o método não considera os eventos na cauda da distribuição, uma vez que são estatisticamente raros e causam grande impacto.

7. Emissão, resgate e amortização de cotas

As cotas da Classe são nominativas, intransferíveis e mantidas em conta de depósito em nome de seus titulares. Têm seu valor calculado diariamente, no encerramento do dia, com base em avaliação patrimonial que considera o valor justo dos ativos financeiros integrantes da carteira, salvo os ativos financeiros classificados como mantidos até o vencimento, quando aplicável. Consequentemente, o valor das cotas da Classe está sujeito às oscilações para mais ou para menos desses ativos financeiros.

a) Emissão

Na emissão das cotas da Classe deve ser utilizado o valor da cota do dia da efetiva disponibilidade dos recursos para a conta da Classe (D+0), desde que respeitado o horário máximo fixado, periodicamente, pelo Administrador.

b) Resgate

O resgate de cotas do Fundo obedecerá às seguintes regras:

Horário Máximo para solicitação de Resgates: 14 horas.

Prazo de Conversão do Resgate: D+29 dias corridos após solicitação

Prazo para Pagamento do Resgate: D+1 dias úteis após conversão

Carência para resgate: Não há

Prazo de carência: Não há

8. Prestação de serviços e custódia

- a) Os serviços de administração, custódia, tesouraria, controle e processamento dos ativos financeiros da carteira da Classe são prestados pelo Banco Daycoval S.A. (“Administrador” e “Custodiante”).

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

- b) Os serviços de gestão da carteira da Classe são prestados pela GCB Capital Gestão de Recursos de Valores Mobiliários Ltda (“Gestora”).
- c) Os títulos públicos federais estão custodiados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia (SELIC), os títulos privados e os instrumentos financeiros derivativos estão custodiados na B3 S.A., as cotas dos fundos de investimentos administrados pelo mesmo Administrador estão custodiadas no Banco Daycoval S.A. e as cotas dos fundos de investimento administrados por outros administradores estão custodiadas nas respectivas instituições administradoras.

9. Remuneração da administração

• Taxa de Administração

Pela prestação dos serviços de administração fiduciária, tesouraria, controle e processamento dos ativos financeiros, distribuição e a escrituração a:

Patrimônio Líquido (em reais)	Administração	
	Taxa (% a.a.)	Mínimo Mensal (em reais)
Até R\$ 100 milhões	0,09% a.a.	R\$ 2.500,00
R\$ 100 milhões – R\$ 300 milhões	0,07% a.a.	
Acima de R\$ 300 milhões	0,04% a.a.	

Base de Cálculo: valor diário do patrimônio líquido do Fundo, na base “1/252” (um sobre duzentos e cinquenta e dois avos) daquela percentagem.

Provisionamento: diário

Base de Cálculo Patrimônio Líquido: D-1

Data de Pagamento: até o 5º (quinto) dia útil do mês subsequente

Índice de Correção: IGP-M

Periodicidade de Correção: anual

Taxa de Administração Máxima: 2,0% a.a. fundos investidos.

No exercício findo em 31 de março de 2026, a despesa de taxa de administração registrada foi de R\$ 50 (R\$ 29 em 2025) e encontra-se apresentada na rubrica de “Taxa de Administração”.

• Taxa de Custódia

Pelos serviços de custódia, será devida pela Classe a seguinte taxa máxima de custódia:

Taxa Máxima de Custódia: 0,03% a.a. (três centésimos por cento) ao ano, respeitado o mínimo mensal de R\$ 1,00 (mil reais)

Base de Cálculo: Patrimônio Líquido da Classe de Cotas

Provisionamento: Diário

Data de Pagamento: 5º (quinto) dia útil do mês subsequente à prestação de serviços

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

Índice de Correção: IGP-M

Periodicidade de Correção: anual

No exercício findo em 31 de março de 2026, a despesa de taxa de custódia registrada foi de R\$ 20 (R\$ 12 em 2025) e encontra-se apresentada na rubrica de “Despesa de controladoria”.

• Taxa de Gestão

Pelos serviços de gestão, será devida pela Classe a seguinte taxa de gestão:

Taxa de Gestão: 0,40% a.a. (quatro décimos por cento ao ano).

Base de Cálculo: valor diário do patrimônio líquido do Fundo, na base “1/252” (um sobre duzentos e cinquenta e dois avos) daquela percentagem.

Provisionamento: diário

Base de Cálculo Patrimônio Líquido: D-1

Data de Pagamento: até o 5º (quinto) dia útil do mês subsequente

Mínimo Mensal: Não há

Índice de Correção: Não há

Periodicidade de Correção: anual

Taxa de Gestão Máxima: Não há. O Fundo estará sujeito às Taxas de Gestão cobrada pelos fundos investidos.

No exercício findo em 31 de março de 2026, a despesa de taxa de gestão registrada foi de R\$ 145 (R\$ 39 em 2025) e encontra-se apresentada na rubrica de “Taxa de gestão”.

• Taxa de performance

Adicionalmente à remuneração acima prevista, a Classe com base em seu resultado, remunera a Gestora mediante o pagamento do equivalente a:

Taxa de Performance: 20%

Método de cálculo: com base no resultado de cada aplicação efetuada por cotista (método do passivo)

Linha D'água: Não

Índice a superar: DI de Um Dia

% a superar: 110% (cento e dez por cento)

Periodicidade da Cobrança: semestral

Meses de apuração: junho e dezembro

Periodicidade de Provisionamento: Diário

Data de Pagamento: 5º dia útil do mês subsequente ao de apuração

No exercício findo em 31 de março de 2026, a despesa de taxa de performance registrada foi de R\$ 154 (R\$ 1 em 2025) e encontra-se apresentada na rubrica de “Taxa de Performance”.

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

• Demais taxas

Não serão devidas pelos cotistas taxas de ingresso e/ou de saída em razão, respectivamente, de aplicações de recursos na Classe e quando do resgate de suas cotas.

10. Transações com partes relacionadas

- a) Em 31 de março de 2026, a Classe possui depositado o montante de R\$ 1, junto ao Banco Daycoval S.A, Administrador do Fundo.
- b) Em 31 de março de 2026, a Classe possui o saldo a pagar de taxa de gestão, no montante de R\$ 50. A despesa registrada nos exercícios findos em 31 de março de 2026 e de 2025, a título de taxa de gestão encontra-se divulgada na nota explicativa nº 9.
- c) Em 31 de março de 2026, a Classe possui o saldo a pagar de taxa de performance, no montante de R\$ 123. A despesa registrada nos exercícios findos em 31 de março de 2026 e de 2025, a título de taxa de performance encontra-se divulgada na nota explicativa nº 9.
- d) Em 31 de março de 2026, a Classe possui o saldo a pagar de taxa de administração no montante de R\$ 9. A despesa registrada no exercício findo em 31 de março de 2026 e de 2025, a título de taxa de administração encontra-se divulgada na nota explicativa nº 9.
- e) Em 31 de março de 2026, a Classe possui o saldo a pagar de taxa de controladoria no montante de R\$ 4. A despesa registrada no exercício findo em 31 de março de 2026 e de 2025 a título de taxa de administração encontra-se divulgada na nota explicativa nº 9.
- f) Apresentamos a seguir o montante das transações com títulos privados realizadas entre a Classe e sua respectiva parte relacionada, Banco Daycoval S.A., para o exercício findo em 31 de março de 2026:

Transações	Modalidade	Montante das transações realizadas	Saldos Existentes	
		Compras	Ativo	Resultado
CRI	Pré	1.500	1.546	46

11. Tributação

a) Fundo

Os rendimentos e ganhos auferidos com operações realizadas pela carteira do Fundo não estão sujeitos ao imposto de renda nem ao IOF.

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

b) Cotistas

Imposto de Renda

Seguindo a expectativa do Administrador e da Gestora de manter a carteira do Fundo com prazo médio superior a trezentos e sessenta e cinco dias, e em conformidade com a Lei nº11.033, de 21 de dezembro de 2004, e demais normativos, os rendimentos produzidos a partir de 1º de janeiro de 2005 são tributados semestralmente, nos meses de maio e novembro de cada ano, à alíquota de 15% (quinze por cento).

Por ocasião do resgate das cotas, serão aplicadas alíquotas complementares, variáveis em razão do prazo de aplicação, conforme segue:

Prazo de aplicação	Alíquota
Até 180 dias	22,50%
De 181 a 360 dias	20,00%
De 361 a 720 dias	17,50%
Acima de 720 dias	15,00%

IOF (Decreto nº 6.306, de 14 de dezembro de 2007)

Os resgates, quando realizados em prazo inferior a 30 dias, estarão sujeitos à cobrança do IOF. A alíquota do IOF será de 1% (um por cento) ao dia sobre o valor do resgate, limitado a um percentual do rendimento da operação decrescente em função do prazo da aplicação. Para os resgates efetuados a partir do trigésimo dia da data da aplicação, não haverá cobrança desse IOF.

Os cotistas isentos, os imunes e os amparados por norma legal ou medida judicial específica não sofrem retenção do imposto de renda na fonte e/ou IOF.

12. Distribuição de resultados

Os resultados auferidos são incorporados ao patrimônio com a correspondente variação no valor das cotas, de maneira que todos os seus condôminos participem proporcionalmente à quantidade de cotas possuídas, de forma que não há distribuição direta de tais resultados aos cotistas da Classe.

13. Política de divulgação de informações

As informações ou documentos para os quais a regulamentação em vigor exija a “comunicação”, “acesso”, “envio”, “divulgação” ou “disponibilização” podem, a exclusivo critério do Administrador:

(i) ser encaminhadas por meio físico aos cotistas; ou

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

(ii) ser comunicados, enviados, divulgados ou disponibilizados aos cotistas, ou por eles acessados, por meio de canais eletrônico ou por outros meios expressamente previstos na regulamentação em vigor, incluindo a rede mundial de computadores (em conjunto, “Comunicação Eletrônica”).

As comunicações exigidas no regulamento do Fundo e na regulamentação em vigor, são consideradas efetuadas na data de sua disponibilização. Admite-se, nas hipóteses em que o regulamento do Fundo ou a regulamentação em vigor exija a “ciência”, “atesto”, “manifestação de voto” ou “concordância” dos cotistas, que estes se deem por meio eletrônico, observados os procedimentos do Administrador.

14. Outras informações

- a) Apresentamos abaixo a rentabilidade, o patrimônio líquido médio e o valor da cota da Classe nos últimos exercícios:

Datas	Patrimônio líquido médio	Valor da cota R\$	Rentabilidade da cota %	Variação CDI %
Exercício findo em 31 de março de 2026	44.738	118,9723	13,78	14,79
Exercício findo em 31 de março de 2025	4.353	104,5641	2,94	11,26

- b) Apresentamos abaixo a rentabilidade mensal da cota da Classe durante o exercício findo em 31 de março de 2026:

Data	Valor da cota	Rentabilidade (Não auditado)			
		Fundo		CDI	
		Mensal	Acumulada	Mensal	Acumulada
31/03/2025	104,5641	-	-	-	-
30/04/2025	105,4181	0,82	0,82	1,06	1,06
31/05/2025	106,3612	0,89	1,72	1,14	2,21
30/06/2025	107,0910	0,69	2,42	1,09	3,33
31/07/2025	108,2390	1,07	3,51	1,28	4,64
31/08/2025	109,4932	1,16	4,71	1,16	5,86
30/09/2025	110,7285	1,13	5,90	1,22	7,15
31/10/2025	111,8649	1,03	6,98	1,28	8,52
30/11/2025	113,1396	1,14	8,20	1,05	9,66
31/12/2025	114,6544	1,34	9,65	1,22	11,00
31/01/2026	116,0952	1,26	11,03	1,16	12,29
28/02/2026	117,3623	1,09	12,24	1,00	13,41
31/03/2026	118,9723	1,37	13,78	1,21	14,79

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

15. Demandas judiciais

Não há registro de demandas judiciais ou extrajudiciais no exercício auditado, quer na defesa dos direitos dos cotistas, quer contra o Administrador do Fundo.

GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO

CNPJ: 52.805.381/0001-80

(Administrado pelo Banco Daycoval S.A.)

CNPJ: 62.232.889/0001-90

Notas explicativas às demonstrações contábeis

Para os exercícios findos em 31 de março de 2026 e 2025

(Em milhares de reais – R\$, exceto o valor unitário das cotas)

16. Prestação de outros serviços e política de independência do auditor

Em atendimento à Instrução CVM nº 162/22, registre-se que o Administrador, no exercício auditado, não contratou nem teve serviços prestados pela PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes relacionados a este Fundo por ele administrado que não os serviços de auditoria externa das demonstrações contábeis do Fundo.

A política adotada atende aos princípios que preservam a independência do auditor, de acordo com os critérios internacionalmente aceitos, quais sejam, o auditor não deve auditar o seu próprio trabalho, nem exercer funções gerenciais no seu cliente ou promover os interesses deste.

17. Alterações estatutárias

Conforme assembleia geral de cotistas realizada em 24 de outubro de 2025 foi deliberado e aprovado:

- 1) A transformação da atual classe única multimercado em classe única renda fixa, conforme regulamento.
- 2) A extensão do prazo de resgate para D+30 (trinta) dias, conforme regulamento anexo a Ata.
- 3) A alteração da política de investimentos, a fim de se adequar ao novo tipo de fundo, qual seja, renda fixa.
- 4) Em caso de aprovação dos itens (2), (3) e (4) acima, realizar a consolidação do regulamento do Fundo, em 28 de outubro de 2025. Assim como realizar a alteração do nome do Fundo de GCB QUANT ALPHA FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO para GCB RENDA FIXA 30 CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO.

18. Outros assuntos

A Comissão de Valores Mobiliários (CVM) publicou em 23 de dezembro de 2022 a Resolução CVM nº175, alterada pelas Resoluções CVM nº181/23 e 184/23, que dispõem sobre a constituição, o funcionamento e a divulgação de informações dos fundos de investimento, bem como sobre a prestação de serviços para os fundos de investimentos. A referida Resolução revoga, dentre outras, a Instrução CVM nº 555/14 e entrará em vigor em 02 de outubro de 2023.

* * *

Erick Warner de Carvalho

Diretor responsável

Diego Scalet

Contador CRC - 1SP305097/O-3