

Termo de compromisso

Instituição participante: Taquari Administradora de Carteira de Valores Mobiliários Ltda. (“Taquari”)

Código: Administração de Recursos de Terceiros (“Código de ART”)

Data da assinatura: 13/09/19

Foi aberto **PAI (Procedimento para Apuração de Irregularidades) nº ART003/2019¹** para apuração de eventuais descumprimentos ao Art. 35 c/c o Art. 36 do Capítulo VII do Anexo I do Código de ART e Art. 16, parágrafo único, das Regras e Procedimentos ANBIMA para Apreçamento nº 01.

Ementa

TERMO DE COMPROMISSO². Instituição prestadora de serviços de administração de fundos de investimento. Falhas na precificação de ativos de crédito privado. Apropriação de ativos financeiros pelas respectivas taxas de emissão ou de aquisição sem observar o seu manual de marcação a mercado e feita em desacordo com as normas de autorregulação.

Considerando que:

- I. A Taquari reconheceu a necessidade de aprimorar as práticas de precificação descritas em seu manual de marcação a mercado (“Manual”);
- II. O impacto financeiro que poderia ser ocasionado pelas supostas falhas na precificação dos ativos seria baixo em relação ao patrimônio líquido do fundo investidor;

¹ Procedimento instaurado no âmbito do Convênio para Aproveitamento da Autorregulação na Indústria de Fundos de Investimento Brasileira, firmado entre a Comissão de Valores Mobiliários e ANBIMA, conforme Anexo I do Convênio e seu pilar de Supervisão do Mercado, com vistas a permitir o maior foco de supervisão e a reduzir sobreposições.

² A celebração de Termo de Compromisso não acarreta confissão quanto à matéria de fato, nem reconhecimento da irregularidade da conduta analisada, e, ainda, suspende o PAI ou Processo em relação às partes até que as obrigações estabelecidas no Termo de Compromisso tenham sido cumpridas e evidenciadas, quando, então, o PAI ou Processo, será arquivado.



III. A Taquari promoveu alterações em seu Manual e encaminhou à ANBIMA evidências de revisão do conteúdo do documento, antes da conclusão do PAI, a fim de adequá-lo às normas de precificação estabelecidas pelo Código de ART.

A celebração de termo de compromisso foi considerada conveniente e oportuna a fim de assegurar que os potenciais descumprimentos apurados no PAI não ocorram futuramente.

Compromissos assumidos:

(i) implementar melhorias no processo de marcação a mercado a fim de aprimorar o controle sobre as decisões tomadas nas análises de precificação e de liquidez de ativos de crédito privado; (ii) encaminhar à ANBIMA as atas de todas as reuniões do Comitê de Riscos da Taquari e os materiais utilizados nessas reuniões durante o período de seis meses contados da celebração do termo de compromisso; e (iii) realizar contribuição financeira no valor total de R\$ 50.000,00 (cinquenta mil reais), destinada a custear eventos e ações educacionais a serem promovidos pela ANBIMA.

