

São Paulo (SP), 22 de maio de 2023.

Aos Cotistas da
VANQUISH ASSET MANAGEMENT LTDA

Ref.: Fatos Relevantes e notícias divulgadas publicamente.
Vanquish Coral FIRF LP e Vanquish Forte Alocação Dinâmica FIRF LP.

Na qualidade de Gestor dos Fundos acima citados, a VANQUISH ASSET LTDA vem esclarecer:

Em referência as cotas dos fundos no dia 18/05/2023, com sentido de informar, em razão da:

- (i) a aplicação de 100% (cem por cento) de PDD (Provisão para Devedores Duvidosos), do ativo IDI's Flexíveis, não liquidadas em 17/05/2023,

Desta forma os fundos sofreram perdas abruptas de acordo com metodologia aplicada pelo Administrador e custodiante dos fundos.

Reforçamos que a VANQUISH ASSET LTDA está em tratativas de forma a negociar com a contraparte das referidas operações não liquidadas em seu vencimento, a fim de elaborar um plano de pagamento a ser apresentado ao administrador dos fundos, que será matéria a ser deliberada em Assembleia aos cotistas.

Uma vez concluída a referida negociação, o administrador poderá reavaliar o assunto e reverter o PDD.

Em referência aos Fatos Relevantes divulgados em 22/05/2023 pela administradora dos fundos, para prestar as seguintes informações aos cotistas dos Fundos:

Tendo assumido a gestão dos Fundos Vanquish Coral FIRF LP e Vanquish Forte Alocação Dinâmica FIRF LP em 04/04/23 e 05/04/23 respectivamente, a VANQUISH ASSET LTDA, passou a envidar esforços no sentido de prover a liquidação dos ativos das carteiras para permitir o pagamento de todos os resgates solicitados pelos cotistas na antiga gestora, levando-se em conta o novo período de carência e pagamento de pedidos de resgates de cotas dos Fundos, conforme constou nos Planos de Ação da antiga gestora aprovados em AGC realizada, previamente ao início de nossas atividades como gestora dos Fundos.

Nas datas de transferências da gestão dos Fundos para a VANQUISH ASSET LTDA, as respectivas carteiras apresentavam concentração em ativos em operações opções IDI's Flexíveis. Referidas operações de balcão foram estruturadas e executadas pelo antigo gestor, com registro CETIP – B3. Como não apresentam liquidez, impossibilitou a execução de zeragem desses ativos. A alternativa adotada então, foi no sentido de se aguardar a liquidação de tais operações em seu vencimento previsto para 17/05/2023.

Cabe ainda esclarecer que nos momentos das transferências dos fundos para a VANQUISH ASSET LTDA, as carteiras estavam desenquadradas nos limites das políticas de investimentos e limites do arcabouço regulatório.

Reiteramos que, a VANQUISH ASSET LTDA vem buscando alternativas de negociação com a contraparte das referidas operações inadimplentes, de modo a permitir e propor negociação a ser elaborada pela atual gestora, VANQUISH ASSET LTDA, negociação e entendimento, a ser encaminhado em momento oportuno após as ações adotadas pelo Administrador do fundo em questão, que deve observar o arcabouço regulatório.

Atenciosamente.

VANQUISH ASSET MANAGEMENT LTDA