



Quantitas

FIC FIM MALLORCA

MAPA DAS ESTRATÉGIAS

			MULTIESTRATÉGIA	PREVIDÊNCIA	MULTIMERCADO JUROS E INFLAÇÃO	RENTA FIXA ATIVO	ARBITRAGEM NA CURVA	LONG & SHORT DE AÇÕES	AÇÕES LONG ONLY
			QUANTITAS FIC FIM MALLORCA	QUANTITAS FIM CAPRI PREV ¹	QUANTITAS FIM GALÁPAGOS	QUANTITAS FIRF ATIVO MALTA	QUANTITAS FIM ARBITRAGEM	QUANTITAS FIM MALDIVAS LS	QUANTITAS FIA MONTECRISTO
JUROS	CONVEXIDADE	5% - 10%	✓				✓		
	PRÉ VALOR RELATIVO ²	20% - 30%	✓	✓	✓	✓			
	PRÉ DIRECIONAL		✓	✓	✓	✓			
	JUROS REAIS VALOR RELATIVO ²		✓	✓	✓	✓			
	JUROS REAIS DIRECIONAL		✓	✓	✓	✓			
	IPCA CP		✓		✓				
	INFLAÇÃO IMPLÍCITA LP	✓	✓	✓	✓				
CÂMBIO	VALOR RELATIVO MOEDAS	15% - 25%	✓	✓					
RENTA VARIÁVEL	DIRECIONAL ÍNDICE	20% - 30%	✓	✓					
	AÇÕES		✓	✓					
	TRADING OPÇÕES		✓	✓					
	LS FUNDAMENTALISTA ³	5% - 15%	✓					✓	
	LS VEC ⁴		✓						✓
QUANT.	LS QUANTITATIVO	5% - 10%	✓						
	QUANT DI		✓		✓				

1 - O QUANTITAS FIM CAPRI PREV SE PROPÕE A REPLICAR AS ESTRATÉGIAS MAIS LÍQUIDAS DO QUANTITAS FIC FIM MALLORCA (555) E É DESTINADO A RECEBER APORTES DOS PLANOS DE PREVIDÊNCIA (PGBL/VGBL) DAS INSTITUIÇÕES ALOCADORAS.

2 - PARA O QUANTITAS FIM CAPRI PREV E O QUANTITAS FIRF ATIVO MALTA, CONSIDERAR SOMENTE OS VÉRTICES MAIS LÍQUIDOS DESSAS ESTRATÉGIAS.

3 - ESSA ESTRATÉGIA É UMA RÉPLICA DO FUNDO QUANTITAS FIM MALDIVAS LS DENTRO DO BOOK DE RENDA VARIÁVEL DO QUANTITAS FIC FIM MALLO RCA.

4 - ESSA ESTRATÉGIA É UMA RÉPLICA DO FUNDO QUANTITAS FIA MONTECRISTO COM HEDGE EM ÍNDICE FUTURO, PORTANTO ENTRA COMO LS NO BOOK DE RENDA VARIÁVEL DO FUNDO QUANTITAS FIC FIM MALLORCA.

 Fechado para novas aplicações.

Quantitas

ESTRATÉGIA DE JUROS

	DIRECIONAL	Juros nominais (PRÉ)	Posições direcionais na curva de juros nominais pré, explorando alta / queda da curva de juros. (EX1: comprar uma alta maior da Selic no próximo COPOM EX2: comprar o juro 2024 esperando um ciclo de alta maior EX3: comprar o juro 2028 esperando maior aversão a risco no mercado)	
		Juros reais (IPCA+)	Similar ao Pré-Direcional, mas aplicado à curva de juros reais (IPCA+)	
	VALOR RELATIVO	Juros nominais (PRÉ)	Posições na curva de juros nominais pré explorando o valor de um vencimento relativo a outro (EX: comprar a inclinação entre 2024 e 2028)	
		Juros reais (IPCA+)	Similar ao Pré-Valor Relativo, mas aplicado à curva de juros reais (IPCA+)	
	CONVEXIDADE	Juros nominais (PRÉ)	Semi-arbitragem de distorções na curva de juros nominais pré utilizando 3 vencimentos. (EX: comprar o juro até 2024, vender 2026 e comprar 2028)	
	INFLAÇÃO	Implícita CP	Posições baseadas no cenário para o IPCA de curto prazo (EX1: comprar o IPCA do próximo mês EX2: comprar o IPCA do ano de 2023)	
		Implícita LP	Posições direcionais ou de valor relativo na inflação implícita de longo prazo (EX: comprar a inflação implícita entre 2026 e 2028 esperando maior aversão a risco no mercado)	

CÂMBIO	Valor Relativo Moedas	Posições entre diferentes pares de moedas.	
REDA VARIÁVEL	Direcional Índice	Posições direcionais em índices futuros do mercado de ações.	
	Ações	Posições em ações específicas, com tomada de decisão pela equipe de gestão dos multimercados, com suporte de research da equipe de renda variável.	
	Trading Opções	Posições em estruturas de opções e volatilidade, englobando risco direcional e arbitragem de distorções na volatilidade implícita.	
	LS Fundamentalista	Estratégia L&S fundamenalista neutra a mercado (i.e. sem exposição direcional) composta por uma carteira long em ações e uma carteira short.	
	LS VEC	Estratégia composta por uma carteira de ações que replica as posições long Only do FIA Montecristo e uma posição short em índice futuro para neutralizar a exposição direcional de notional.	
QUANT	LS Quantitativo	Estratégia L&S de ações quantitativa neutra a mercado para arbitragem de distorções via modelagem estatística.	

TOMADA DE DECISÃO | MULTIMERCADOS

				Gestão Multimercados			Gestão Renda Variável		
				Tipos Book	Gestor do Fundo	Traders	Economistas	Equipe Long Short	Equipe Long Only
JUROS	DIRECIONAL	Pré Valor Relativo	IG/IT	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>		
		Pré Direcional	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>			
	VALOR RELATIVO	Juros Reais Valor Relativo	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>			
		Juros Reais Direcional	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>			
	CONVEXIDADE	Juros nominais (PRÉ)	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>				
	INFLAÇÃO	Inflação Implícita CP	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>			
		Inflação Implícita LP	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>			
CÂMBIO		Valor Relativo Moedas	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>			
REDA VARIÁVEL		Direcional Índice	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>			
		Ações	IG/IT/IE/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div></div>	
		Trading Opções	IT/G	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>				
		LS Fundamentalista	RV	<div><div></div></div>		<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>	<div><div></div></div>	
		LS VEC	RV	<div><div></div></div>		<div><div></div></div>	<div><div></div></div>	<div><div></div><div></div></div>	
QUANT		LS Quantitativo	IT	<div><div></div></div>	<div><div></div></div>				

LEGENDAS

IG: book decisão individual do gestor

G: book decisão em grupo com participação do gestor

I: book decisão individual de membros da equipe de gestão
(Sem a participação do gestor)

RV: book decisão equipe de renda variável

- Define as regras gerais e delega o risco
- Toma decisão de investimento
- Contribui como fornecedor de research/pesquisa

GRÁFICO DE DESEMPENHO

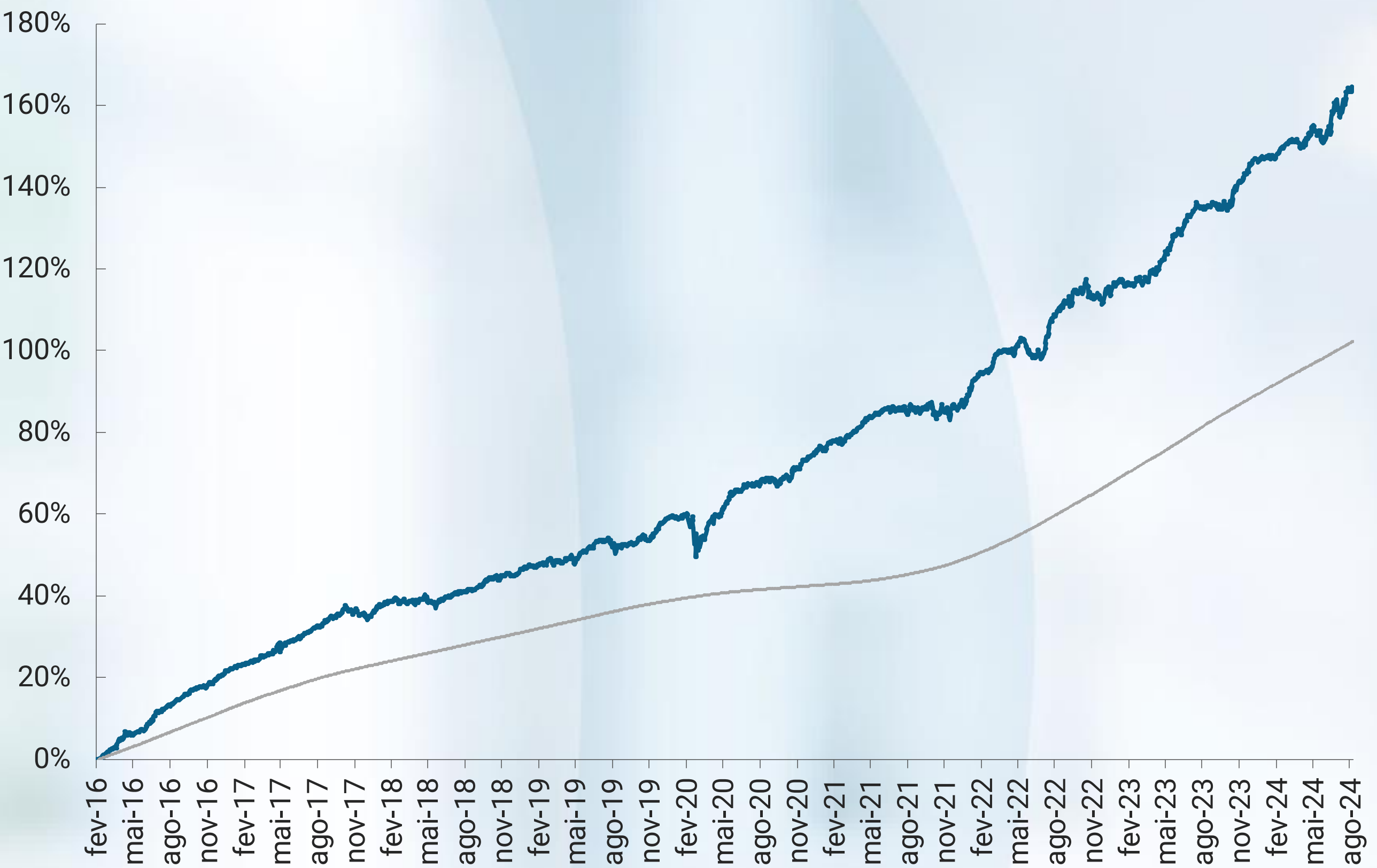


TABELA DE RENTABILIDADES

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acumulado
2016	Fundo	-	0,43%	2,47%	3,71%	0,14%	2,18%	2,77%	1,80%	1,41%	1,72%	0,85%	1,88%	21,10%	21,10%
	% CDI	-	164,93%	212,58%	351,72%	12,90%	187,56%	250,55%	148,17%	127,43%	164,50%	82,10%	167,05%	176,03%	176,03%
	DI +	-	0,17%	1,31%	2,65%	-0,96%	1,02%	1,67%	0,58%	0,30%	0,68%	-0,19%	0,75%	9,11%	9,11%
2017	Fundo	1,48%	0,58%	1,41%	0,48%	2,01%	1,16%	1,07%	1,41%	1,39%	1,27%	-0,94%	-0,23%	11,63%	35,18%
	% CDI	135,92%	66,55%	134,29%	61,06%	217,08%	142,83%	133,60%	175,68%	216,26%	197,07%	-164,79%	-42,35%	116,86%	152,10%
	DI +	0,39%	-0,29%	0,36%	-0,31%	1,08%	0,35%	0,27%	0,61%	0,75%	0,63%	-1,50%	-0,77%	1,68%	12,05%
2018	Fundo	2,20%	0,92%	-0,59%	0,41%	-0,62%	1,03%	0,61%	0,73%	0,58%	1,48%	0,71%	0,07%	7,77%	45,69%
	% CDI	377,82%	198,20%	-110,73%	80,00%	-120,25%	198,93%	113,33%	128,46%	123,47%	273,10%	144,40%	13,73%	121,01%	147,20%
	DI +	1,62%	0,46%	-1,12%	-0,10%	-1,14%	0,51%	0,07%	0,16%	0,11%	0,94%	0,22%	-0,43%	1,35%	14,65%
2019	Fundo	1,19%	0,43%	0,31%	0,42%	0,99%	0,95%	0,90%	-0,60%	0,31%	0,79%	0,60%	2,41%	9,03%	58,85%
	% CDI	219,02%	87,22%	66,18%	80,59%	183,00%	203,51%	159,00%	-119,80%	66,97%	164,05%	157,00%	641,18%	151,39%	151,45%
	DI +	0,65%	-0,06%	-0,16%	-0,10%	0,45%	0,49%	0,34%	-1,11%	-0,15%	0,31%	0,22%	2,04%	3,07%	19,99%
2020	Fundo	0,12%	-0,96%	-1,87%	3,27%	2,19%	1,64%	0,72%	0,51%	-0,36%	0,57%	2,31%	1,82%	10,29%	75,20%
	% CDI	32,25%	-325,93%	-550,94%	1146,16%	918,31%	761,24%	373,04%	315,42%	-230,95%	360,97%	1546,17%	1109,01%	371,75%	176,09%
	DI +	-0,26%	-1,26%	-2,22%	2,98%	1,95%	1,42%	0,53%	0,35%	-0,52%	0,41%	2,16%	1,66%	7,52%	32,49%
2021	Fundo	0,41%	0,93%	1,19%	1,54%	1,21%	0,66%	-0,13%	0,19%	0,10%	-1,49%	0,17%	2,32%	7,27%	87,93%
	% CDI	271,46%	691,13%	598,93%	739,61%	453,00%	215,84%	-35,20%	45,12%	22,26%	-311,08%	28,78%	303,64%	165,32%	179,53%
	DI +	0,26%	0,80%	0,99%	1,33%	0,94%	0,35%	-0,48%	-0,23%	-0,34%	-1,97%	-0,42%	1,55%	2,87%	38,95%
2022	Fundo	2,71%	0,92%	2,41%	0,23%	1,36%	-2,23%	2,75%	2,98%	1,00%	1,96%	-1,09%	0,94%	14,71%	115,56%
	% CDI	369,71%	123,36%	260,53%	27,92%	132,12%	-219,60%	265,59%	254,95%	93,43%	191,79%	-106,98%	83,49%	118,85%	171,43%
	DI +	1,98%	0,18%	1,48%	-0,60%	0,33%	-3,24%	1,71%	1,81%	-0,07%	0,94%	-2,11%	-0,19%	2,33%	48,15%
2023	Fundo	0,80%	-0,40%	0,49%	1,30%	2,19%	2,07%	2,08%	0,19%	0,34%	-0,08%	2,95%	1,88%	14,65%	147,14%
	% CDI	71,57%	-43,08%	41,98%	141,17%	194,55%	192,69%	193,98%	16,86%	34,71%	-7,79%	321,08%	210,10%	112,27%	164,86%
	DI +	-0,32%	-1,31%	-0,68%	0,38%	1,06%	0,99%	1,01%	-0,95%	-0,64%	-1,08%	2,03%	0,99%	1,60%	57,89%
2024	Fundo	0,25%	0,62%	0,99%	-0,64%	1,12%	0,07%	2,51%	1,80%	-	-	-	-	6,91%	164,21%
	% CDI	25,74%	77,86%	119,27%	-71,58%	134,99%	9,43%	276,73%	240,33%	-	-	-	-	99,08%	160,29%
	DI +	-0,72%	-0,18%	0,16%	-1,52%	0,29%	-0,71%	1,60%	1,05%	-	-	-	-	-0,06%	61,76%

* Ago/24: atualizado até 27/08/2024

EVOLUÇÃO DE PATRIMÔNIO LÍQUIDO

PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL

R\$ 1.600.870.760,68

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO

R\$ 1.483.704.410,88

FONTE: INTRAG | DATA-BASE: 27/08/2024

ASPECTOS OPERACIONAIS

APLICAÇÃO INICIAL MÍNIMA: R\$ 1.000,00

MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA: R\$ 1.000,00

VALOR DE PERMANÊNCIA NO FUNDO: R\$ 1.000,00

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 1,80% A.A.

TAXA DE PERFORMANCE: 20% SOBRE O QUE EXCEDER 100% DO CDI

COTIZAÇÃO DO RESGATE: D+14 DIAS CORRIDOS

LIQUIDAÇÃO DO RESGATE: D+1 DIA ÚTIL APÓS A COTIZAÇÃO

Quantitas

DESTAQUES



Todos os fundos multimercados da Quantitas estão classificados com 5 estrelas pela Morningstar (janelas de 3 e 5 anos).

Quantitas Mallorca FIC FIM			
Rating Morningstar™(Relativo à categoria)			31/03/2024
	Rentabilidade Morningstar	Risco Morningstar	Rating Morningstar™
3Anos	Above Average	Average	★★★★
5Anos	Above Average	Average	★★★★★
10Anos	-	-	Sem rating
Global	Above Average	Average	★★★★★

Quantitas Galápagos FIM			
Rating Morningstar™(Relativo à categoria)			31/03/2024
	Rentabilidade Morningstar	Risco Morningstar	Rating Morningstar™
3Anos	Alto	Average	★★★★★
5Anos	Alto	Above Average	★★★★★
10Anos	-	-	Sem rating
Global	Alto	Above Average	★★★★★

Quantitas Arbitragem FIM LP			
Rating Morningstar™(Relativo à categoria)			31/03/2024
	Rentabilidade Morningstar	Risco Morningstar	Rating Morningstar™
3Anos	Alto	Above Average	★★★★★
5Anos	Alto	Above Average	★★★★★
10Anos	-	-	Sem rating
Global	Alto	Above Average	★★★★★

ÍNDICE DE HEDGE FUNDS

QUANTITAS FIM ARBITRAGEM LP

Data de entrada: abril/2021

QUANTITAS FIC FIM MALLORCA

Data de entrada: junho/2020

QUANTITAS RECONHECIDA MAIS DE 80 VEZES NO

TOP 5

BANCO CENTRAL DO BRASIL

1º LUGAR | IPCA CP | 1º LUGAR | IPCA MP
2º LUGAR | IPCA LP | 3º LUGAR | SELIC CP

GUIA VALOR

DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

Os melhores fundos multimercados de 2023					
Fundo multimercado	Retorno em 2023 (em %)	Retorno em 2022 (em %)	Risco	Patrimônio líquido (em R\$)	Cotistas
Carreira Multic FIC FIM	28,74	4,33	6,18	144.756.473	1.317
Magellan Investimentos FIM	22,27	11,23	5,67	107.294.473	3.086
Equilíbrio Magellan Investimentos Control FIC FIM	17,37	42,87	17,14	207.625.866	3.862
BB Global Multic FIM LP	16,45	1,87	5,89	226.176.333	1.119
AG Global Multic Multic FIC FIM	16,73	16,76	5,67	226.047.963	4.285
Acumulado FIC FIM	15,86	12,19	5,85	207.274.135	19.424
Arteson Real FIC FIM	15,48	21,86	4,52	245.796.135	1.345
Novo Horizonte FIC FIM	14,65	22,87	7,10	767.226.312	1.714
Quantitas Mallorca FIC FIM	14,65	14,71	3,71	1.422.291.373	26.828
Carreira Multic FIM LP	14,49	1,28	5,71	226.176.333	1.119

Fonte: Valor Investe.

As informações contidas neste documento foram produzidas pela Quantitas Gestão de Recursos, dentro das condições atuais de mercado e conjuntura. Todas as recomendações e estimativas aqui apresentadas derivam do nosso julgamento e podem ser alteradas a qualquer momento sem aviso prévio. A rentabilidade divulgada não é líquida de imposto. Ressaltamos que rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. As informações do presente material são exclusivamente informativas. Recomendamos ao investidor a leitura cuidadosa do prospecto e do regulamento dos fundos de investimento ao aplicar seus recursos. Ressaltamos que os fundos de investimento não constam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. A Quantitas Gestão de Recursos não se responsabiliza por decisões de investimentos tomadas com base nos dados aqui divulgados. Para avaliação de performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze meses).



Quantitas



FAÇA PARTE DA NOSSA
COMUNIDADE DE WHATSAPP



Av. Nilo Peçanha 2825/1001
Porto Alegre / RS



@quantitasgestaoderecursos



quantitas.com.br