

GRÁFICO DE EVOLUÇÃO DO FUNDO

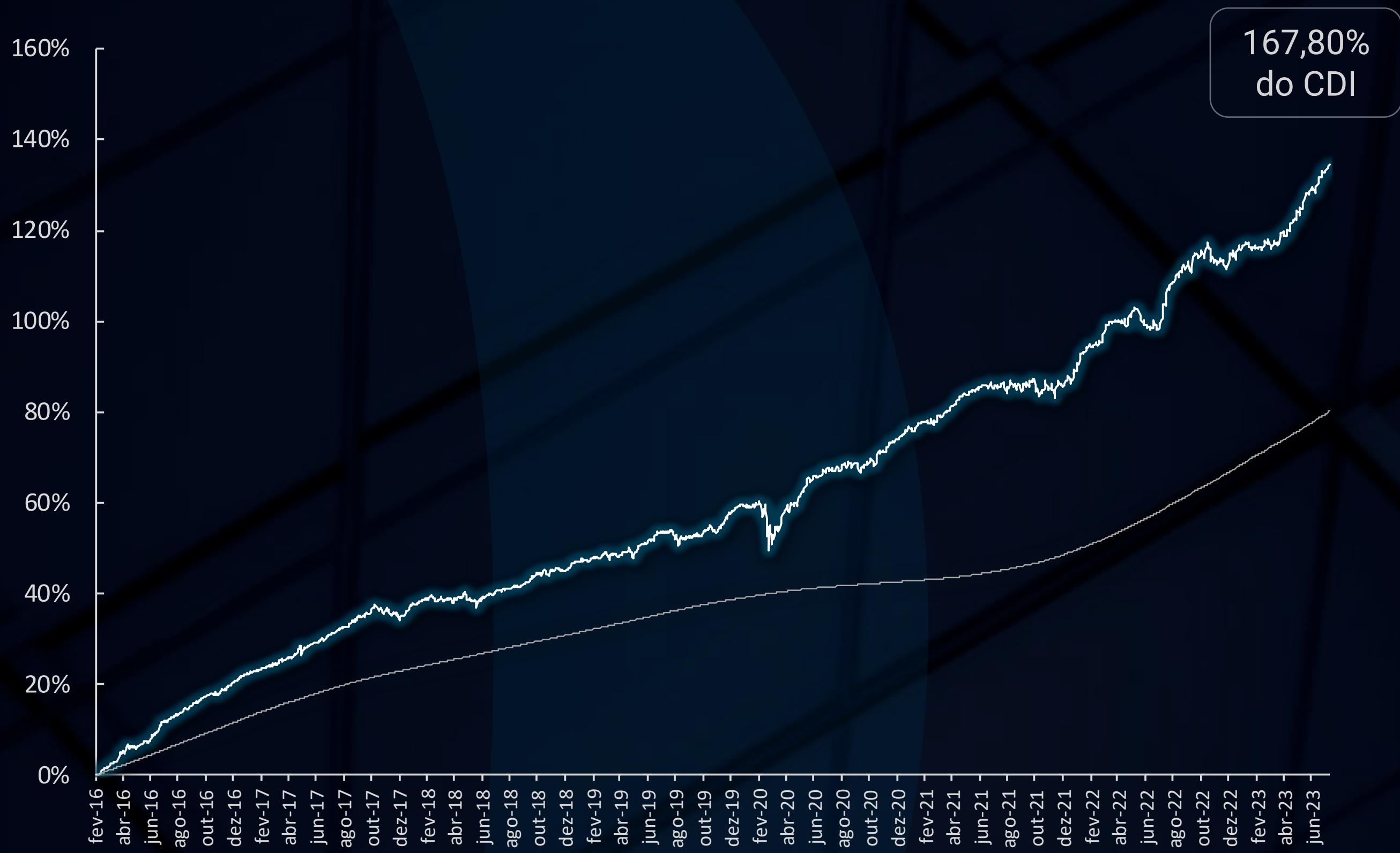


TABELA DE RENTABILIDADES

| | | 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% | 13,75% | 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% | | | | | | 8,82% | 134,56% |
| | % CDI | 71,57% | -43,08% | 41,98% | 141,17% | 194,55% | 192,69% | 193,98% | | | | | | 115,39% | 167,79% |
| | DI + | -0,32% | -1,31% | -0,68% | 0,38% | 1,06% | 0,99% | 1,01% | | | | | | 1,18% | 54,37% |

Quantitas | FIC FIM MALLORCA

MAPA DE ESTRATÉGIAS

| | | xp | xp | xp | xp | | |
|-----------------|---|-----------------|-------------|-------------------------------|---------------------|-----------------------|-----------------|
| | RANGE TARGET DE ALOCAÇÃO DE RISCO NO MALLORCA | MULTIESTRATÉGIA | PREVIDÊNCIA | MULTIMERCADO JUROS E INFLAÇÃO | ARBITRAGEM NA CURVA | LONG & SHORT DE AÇÕES | AÇÕES LONG ONLY |
| JUROS | 5% - 10% | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | | |
| | 20% - 30% | ✓ | ✓ | ✓ | ✓ | | |
| CÂMBIO | 15% - 25% | ✓ | ✓ | | | | |
| RENDAM VARIÁVEL | 20% - 30% | ✓ | ✓ | | | | |
| QUANT. | 5% - 15% | ✓ | | | | ✓ | ✓ |
| | 5% - 10% | ✓ | ✓ | ✓ | | | |

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, 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 MALLORCA.

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.

Quantitas | FIC FIM MALLORCA

ESTRATÉGIAS | MULTIMERCADOS

| | | | |
|----------------|----------------------|---|--|
| 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 | |
| RENDIMENTO 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 fundamentalista 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 | |

Quantitas | FIC FIM MALLORCA

TOMADA DE DECISÃO | MULTIMERCADOS

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

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



Quantitas | FIC FIM MALLORCA

EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO

FONTE: INTRAG | DATA-BASE: 31/07/2023

PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL

R\$ 822.124.314,78

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO

R\$ 590.022.056,22

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 | FIC FIM MALLORCA

DESTAQUES RECENTES

PREGIN LEAGUE TABLES 2023: HEDGE FUNDS

Quantitas Gestão de Recursos

| Rank | Asset Class | Category | Fund |
|------|-------------|--|--------------------------|
| 9 | Hedge Funds | Top Performing Relative Value Strategy Hedge Funds in 2022 | Quantitas FIM Arbitragem |

FUNDOS 5 ESTRELAS NA MORNINGSTAR

Quantitas Mallorca FIC FIM

| Rating Morningstar™ (Relativo à categoria) | | | |
|--|-------------------|---------------------|------------|
| Rentabilidade Morningstar | Risco Morningstar | Rating Morningstar™ | 30/04/2023 |
| 3Anos Above Average | Average | ★★★★★ | |
| 5Anos Above Average | Below Average | ★★★★★ | |
| 10Anos - | - | Sem rating | |
| Global Above Average | Below Average | ★★★★★ | |

Categoria : Alternativos – Multiestratégia Clique aqui para consultar a nossa Metodologia

Quantitas Maldivas Long Short FIM

| Rating Morningstar™ (Relativo à categoria) | | | |
|--|-------------------|---------------------|------------|
| Rentabilidade Morningstar | Risco Morningstar | Rating Morningstar™ | 28/02/2023 |
| 3Anos Alto | Baixo | ★★★★★ | |
| 5Anos - | - | Sem rating | |
| 10Anos - | - | Sem rating | |
| Global Alto | Baixo | ★★★★★ | |

Categoria : Ações – Livre Clique aqui para consultar a nossa Metodologia

Quantitas Galápagos FIM

| Rating Morningstar™ (Relativo à categoria) | | | |
|--|-------------------|---------------------|------------|
| Rentabilidade Morningstar | Risco Morningstar | Rating Morningstar™ | 28/02/2023 |
| 3Anos Alto | Above Average | ★★★★★ | |
| 5Anos Alto | Above Average | ★★★★★ | |
| 10Anos - | - | Sem rating | |
| Global Alto | Above Average | ★★★★★ | |

Categoria : Títulos Governamentais Clique aqui para consultar a nossa Metodologia

Quantitas Arbitragem FIM LP

| Rating Morningstar™ (Relativo à categoria) | | | |
|--|-------------------|---------------------|------------|
| Rentabilidade Morningstar | Risco Morningstar | Rating Morningstar™ | 28/02/2023 |
| 3Anos Alto | Above Average | ★★★★★ | |
| 5Anos Alto | Above Average | ★★★★★ | |
| 10Anos - | - | Sem rating | |
| Global Alto | Above Average | ★★★★★ | |

Categoria : Dívida & Moedas Clique aqui para consultar a nossa Metodologia

GUIA VALOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTO



Multimercado

10 com melhor relação risco retorno

Quantitas Galápagos FIM

Quantitas Gestão de Recursos

Data da publicação: dez/2022

5 com mais cotistas

Quantitas Mallorca FIC FIM

Quantitas Gestão de Recursos

Resultados consistentes

Fundos que se mantêm entre os 20% melhores desde 2019

RF DI

Multimercado

Quantitas Galápagos FIM

ÍNDICE DE HEDGE FUNDS



QUANTITAS FIM ARBITRAGEM LP

Data de entrada: abril/2021

QUANTITAS FIC FIM MALLORCA

Data de entrada: junho/2020

QUANTITAS FIM GALÁPAGOS

Data de entrada: janeiro/2020

QUANTITAS RECONHECIDA MAIS DE 80 VEZES NO



TOP 5



1º LUGAR | IPCA CP | 1º LUGAR | IPCA MP

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

Quantitas | FIC FIM MALLORCA

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
LISTA DE TRANSMISSÃO

📍 Av. Nilo Peçanha 2825/1001
Porto Alegre / RS