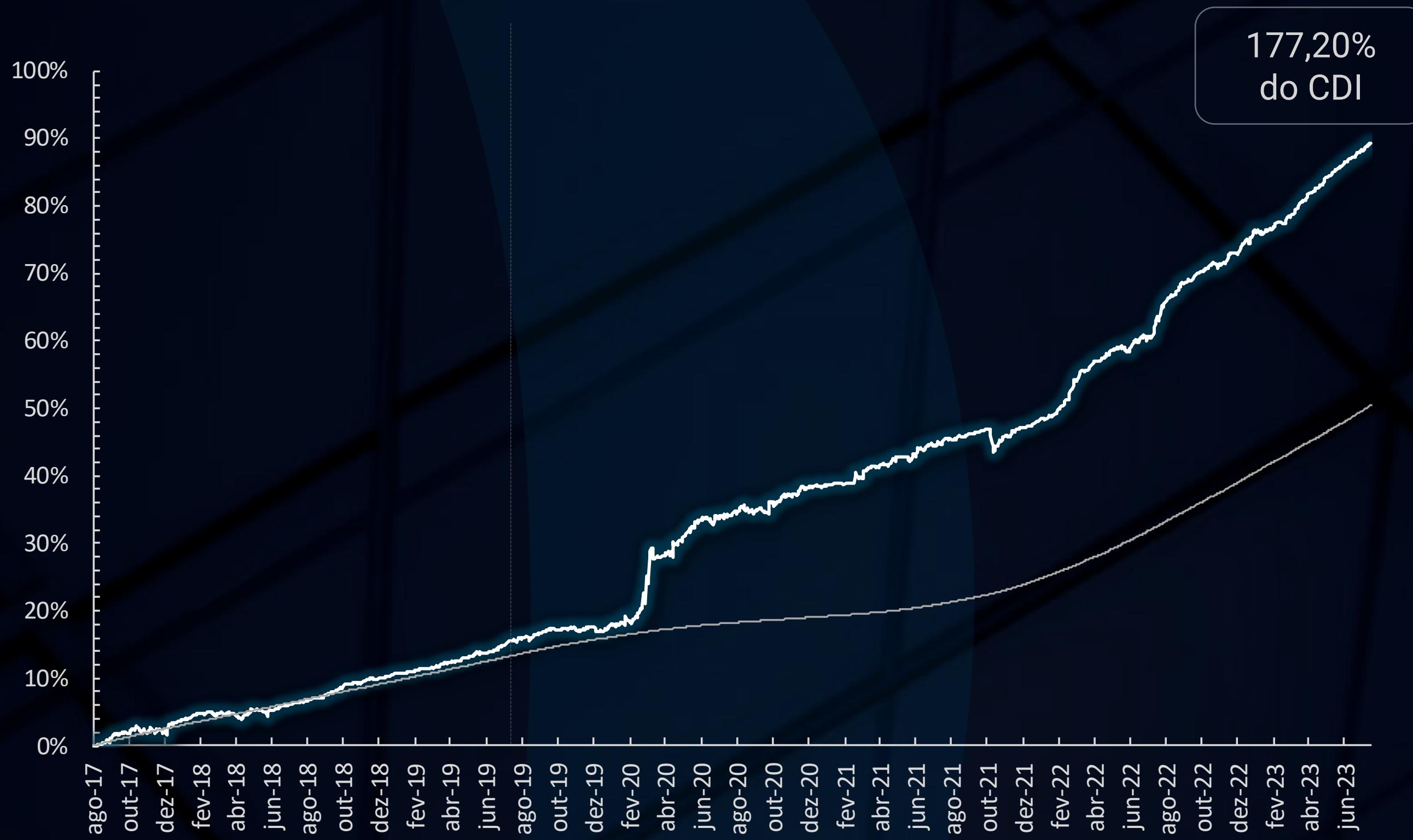


GRÁFICO DE EVOLUÇÃO DO FUNDO



Linha pontilhada: incorporação de novas estratégias e elevação de vol.

TABELA DE RENTABILIDADES

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acumulado
2017	Fundo	-	-	-	-	-	-	0,46%	1,24%	0,69%	0,06%	0,81%	3,30%	3,30%
	% CDI	-	-	-	-	-	-	119,77%	193,19%	107,57%	10,28%	149,46%	117,38%	117,38%
	DI +	-	-	-	-	-	-	0,08%	0,60%	0,05%	-0,51%	0,27%	0,49%	0,49%
2018	Fundo	1,08%	0,61%	-0,33%	-0,23%	0,58%	0,77%	0,52%	0,60%	0,89%	1,08%	0,72%	0,29%	6,78% 10,29%
	% CDI	185,62%	131,87%	-61,59%	-44,55%	111,61%	149,38%	95,28%	105,89%	190,35%	198,54%	145,85%	58,74%	105,49% 109,39%
	DI +	0,50%	0,15%	-0,86%	-0,75%	0,06%	0,26%	-0,03%	0,03%	0,42%	0,54%	0,23%	-0,20%	0,35% 0,88%
2019	Fundo	0,58%	0,48%	0,55%	0,50%	0,96%	0,35%	1,17%	0,49%	1,09%	-0,06%	-0,02%	-0,19%	6,07% 16,99%
	% CDI	107,59%	98,26%	118,13%	97,39%	176,78%	75,40%	205,63%	97,63%	234,31%	-12,17%	-5,44%	-51,02%	101,75% 106,60%
	DI +	0,04%	-0,01%	0,09%	-0,01%	0,42%	-0,12%	0,60%	-0,01%	0,63%	-0,54%	-0,40%	-0,57%	0,10% 1,05%
2020	Fundo	1,18%	1,05%	6,99%	1,40%	2,09%	0,85%	0,37%	0,52%	-0,01%	1,54%	0,74%	0,45%	18,37% 38,48%
	% CDI	313,01%	354,79%	2055,39%	490,03%	877,00%	397,01%	187,97%	321,22%	-8,66%	980,03%	498,13%	272,60%	663,71% 200,96%
	DI +	0,80%	0,75%	6,65%	1,11%	1,85%	0,64%	0,17%	0,36%	-0,17%	1,38%	0,60%	0,28%	15,60% 19,33%
2021	Fundo	0,24%	0,04%	1,79%	0,26%	0,81%	0,68%	0,91%	0,46%	0,48%	-1,50%	1,47%	0,79%	6,59% 47,61%
	% CDI	160,67%	30,25%	904,28%	127,12%	302,90%	224,14%	256,56%	108,71%	108,61%	-312,89%	250,24%	103,55%	149,94% 195,23%
	DI +	0,09%	-0,09%	1,59%	0,06%	0,54%	0,38%	0,56%	0,04%	0,04%	-1,98%	0,88%	0,03%	2,20% 23,22%
2022	Fundo	0,79%	1,62%	2,93%	1,12%	1,18%	0,30%	2,08%	2,40%	1,33%	1,23%	0,92%	1,26%	18,54% 74,98%
	% CDI	108,09%	216,55%	317,00%	133,90%	114,17%	29,37%	201,46%	205,64%	123,91%	120,81%	90,41%	111,91%	149,87% 188,51%
	DI +	0,06%	0,87%	2,00%	0,28%	0,15%	-0,72%	1,05%	1,23%	0,26%	0,21%	-0,10%	0,13%	6,17% 35,21%
2023	Fundo	0,74%	0,78%	1,50%	1,28%	1,44%	1,09%	1,12%	-	-	-	-	-	8,25% 89,41%
	% CDI	66,13%	85,49%	128,00%	139,79%	128,54%	101,74%	104,62%	-	-	-	-	-	107,92% 177,20%
	DI +	-0,38%	-0,13%	0,33%	0,37%	0,32%	0,02%	0,05%	-	-	-	-	-	0,61% 38,95%

Quantitas | FIM GALÁPAGOS

MAPA DE ESTRATÉGIAS



		MULTIESTRATÉGIA	PREVIDÊNCIA	MULTIMERCADO JUROS E INFLAÇÃO	ARBITRAGEM NA CURVA	LONG & SHORT DE AÇÕES	AÇÕES LONG ONLY
	RANGE TARGET DE ALOCAÇÃO DE RISCO NO MALLORCA	QUANTITAS FIC FIM MALLORCA	QUANTITAS FIM CAPRI PREV ¹	QUANTITAS FIM GALÁPAGOS	QUANTITAS FIM ARBITRAGEM	QUANTITAS FIM MALDIVAS LS	QUANTITAS FIA MONTECRISTO
JUROS	CONVEXIDADE	5% - 10%	✓				
	PRÉ VALOR RELATIVO ²		✓	✓			
	PRÉ DIRECIONAL		✓	✓			
	JUROS REAIS VALOR RELATIVO ²	20% - 30%	✓	✓	✓		
	JUROS REAIS DIRECIONAL		✓	✓	✓		
	IPCA CP		✓	✓	✓		
CÂMBIO	INFLAÇÃO IMPLÍCITA LP		✓	✓	✓		
	VALOR RELATIVO MOEDAS	15% - 25%	✓	✓			
RENDAS VARIÁVEIS	DIRECIONAL ÍNDICE		✓	✓			
	AÇÕES	20% - 30%	✓	✓			
	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 APORTE 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.

ESTRATÉGIAS DE JUROS

CNPJ: 27.928.186/0001-08

CÓDIGO ANBIMA: 447511

CÓDIGO ISIN: BRGLP6CTF003

CÓDIGO BLOOMBERG: QUANGAL BZ EQUITY

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)	

Quantitas | FIM GALÁPAGOS

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	Valor Relativo Moedas	IG I G	● ●	●	● ●	
	RENDA VARIÁVEL	Direcional Índice	IG I G	● ●	●	● ●	
		Ações	IG I G	● ●	●	● ●	● ●
		Trading Opções	I G	● ●	●		
		LS Fundamentalista	RV	●		●	● ●
		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



ROGÉRIO BRAGA ■■■
GESTÃO DE MULTIMERCADOS

TRADING



MATHEUS GALLINA ■■



LUCAS MONTEIRO ■■



JOÃO PEDRO OLIVEIRA

ANÁLISE ECONÔMICA



IVO CHERMONT ■■



JOÃO FERNANDES ■■■



KEVIN PERGHER



VINICIUS TREVELIN



ARTHUR GASPARETO

■ SÓCIO ■ CEA ■ CFA ■ CGA

Quantitas | FIM GALÁPAGOS

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 | FIM GALÁPAGOS

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™
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™
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™
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™
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

Valor ECONÔMICO

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

BANCO CENTRAL DO BRASIL

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

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

Quantitas | FIM GALÁPAGOS

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