

# Quantitas

**CAPRI XP SEG PREV FIC FIM**

# ESTRATÉGIAS

			MULTIESTRATÉGIA	PREVIDÊNCIA
			QUANTITAS FIC FIM MALLORCA	QUANTITAS FIM CAPRI PREV
JUROS	CONVEXIDADE	10%	✓	
	PRÉ VALOR RELATIVO	20% - 30%	✓	✓
	PRÉ DIRECIONAL		✓	✓
	JUROS REAIS VALOR RELATIVO		✓	✓
	JUROS REAIS DIRECIONAL		✓	✓
	IPCA CP		✓	
	INFLAÇÃO IMPLÍCITA LP		✓	✓
CÂMBIO	VALOR RELATIVO MOEDAS	15% - 25%	✓	✓
RENDA VARIÁVEL	DIRECIONAL ÍNDICE	20% - 30%	✓	✓
	AÇÕES		✓	✓
	TRADING OPÇÕES		✓	✓
	LS FUNDAMENTALISTA*	5% - 15%	✓	
	LS VEC**		✓	
QUANT.	LS QUANTITATIVO	5% - 10%	✓	
	QUANT DI		✓	

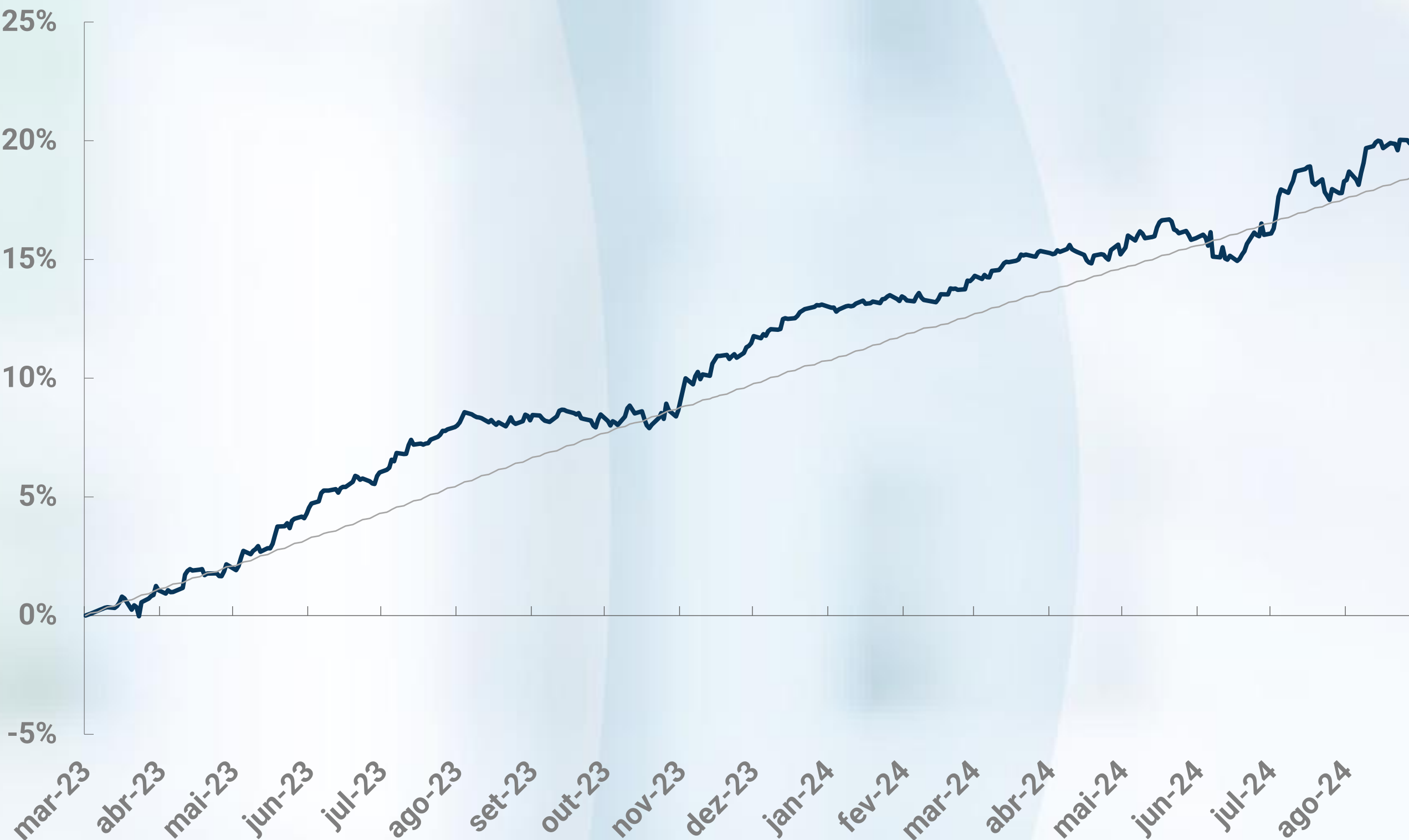
\*Somente vértices mais líquidos

\*\*O Quantitas FIM Capri Prev se propõe a replicar as estratégias mais líquidas do Quantitas FIC FIM Mallorca | Small Caps com baixa liquidez não compõem a carteira

# ESTRUTURAÇÃO

- APENAS ESTRATÉGIAS DEMONSTRADAS NO QUADRO ACIMA
- VOL TARGET: 4,5% a.a | OBJETIVO DE RETORNO: CDI+3% a.a.
- GERADO A PARTIR DO HISTÓRICO DE ESTRATÉGIAS DO QUANTITAS MALLORCA
- AJUSTE E SHARPE DAS ESTRATÉGIAS DE JUROS

# GRÁFICO DE DESEMPENHO



# TABELA DE RENTABILIDADES

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acumulado
2023	Fundo			1,07%	1,08%	2,09%	1,66%	1,80%	0,26%	0,22%	0,17%	2,60%	1,46%	13,10%	13,10%
	% CDI			99,71%	117,13%	186,42%	155,15%	167,98%	23,25%	23,07%	17,02%	283,15%	162,76%	122,24%	122,24%
	DI +			0,00%	0,16%	0,97%	0,59%	0,73%	-0,87%	-0,75%	-0,83%	1,68%	0,56%	2,38%	2,38%
2024	Fundo	0,30%	0,66%	1,02%	-0,12%	0,59%	0,12%	1,95%	1,35%	-	-	-	-	6,00%	19,89%
	% CDI	31,23%	81,69%	122,74%	-13,40%	70,49%	15,36%	214,67%	179,80%	-	-	-	-	86,06%	107,87%
	DI +	-0,66%	-0,15%	0,19%	-1,01%	-0,25%	-0,67%	1,04%	0,60%	-	-	-	-	-0,97%	1,45%

\* Ago/24: atualizado até 27/08/2024

FONTE: CVM

# EVOLUÇÃO DE PATRIMÔNIO LÍQUIDO

PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL

**R\$ 232.226.798,59**

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO

**R\$ 151.439.740,47**

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

## ASPECTOS OPERACIONAIS

APLICAÇÃO INICIAL MÍNIMA: R\$ 500,00

MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA: R\$ 100,00

VALOR DE PERMANÊNCIA NO FUNDO: R\$ 100,00

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 1,80% A.A.<sup>1</sup>

TAXA DE PERFORMANCE: 20% SOBRE O QUE EXCEDER 100% DO CDI <sup>2</sup>

COTIZAÇÃO DO RESGATE: D+8 DIAS CORRIDOS

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

<sup>1</sup>Taxa de administração efetiva\*

<sup>2</sup>Taxa de performance da estrutura

\*Custos para PF



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	1.017
Magellan Investimentos FIM	22,27	11,22	5,67	107.294.473	3.086
Equilíbrio Magellan Investimentos Multimercado FIC FIM	17,97	42,87	17,14	207.625.944	3.882
BB Capital Multimercado FIM LP	16,45	1,87	5,89	226.174.555	1.119
AG Global Multimercado FIC FIM	16,75	16,76	5,87	226.047.963	4.285
Acumulado FIC FIM	15,88	12,19	5,85	207.574.110	10.404
Arteson Real FIC FIM	15,48	21,86	4,52	245.796.110	1.345
Novo Horizonte FIC FIM	14,65	22,87	7,10	767.226.512	1.714
Quantitas Mallorca FIC FIM	14,65	14,71	3,71	1.422.291.373	26.828
Carreira Multic FIM LP	14,48	1,28	5,17	226.174.555	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

# Quantitas



FAÇA PARTE DA NOSSA  
COMUNIDADE DE WHATSAPP



Av. Nilo Peçanha 2825/1001  
Porto Alegre / RS



@quantitasgestaoderecursos



quantitas.com.br