



**Quantitas**



**INSTITUCIONAL**

# QUEM SOMOS



**R\$ 5,5 BI**

DE ATIVOS SOB GESTÃO



**+ 14 ANOS**

GERINDO FUNDOS DE  
INVESTIMENTO



**+ 25.000**

INVESTIDORES



**31**

COLABORADORES



**13 SÓCIOS**

MODELO DE PARTNERSHIP

## GESTÃO DE FUNDOS



**RENDA FIXA/CP**

3 fundos  
(2 mandatos exclusivos)



**MULTIMERCADOS**

5 fundos



**AÇÕES**

2 fundos  
(long-only e long&short)

# LINHA DO TEMPO

**FUNDADA EM AGOSTO EM PORTO ALEGRE/RS**

**MIGRAÇÃO DO FIFA MONTECRISTO E FIF RF UBR III PARA A GESTÃO DA QUANTITAS**

(long only de ações e mandato exclusivo)

**2011**

**2014**

**CRIAÇÃO DO QUANTITAS FIF MULT ARBITRAGEM**

(convexidade curva de juros)

**2016**

**CRIAÇÃO DO QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA**

(multiestratégias em juros, câmbio e bolsa)

**QUANTITAS SELECIONADA PARA GERIR FIF QP3**  
(mandato exclusivo)

**2017**

**MUDANÇA NO CONTROLE SOCIETÁRIO DA QUANTITAS**

3 sócios aumentaram participação (de 35% p/ 85%) e mais 6 novos profissionais se tornaram sócios com 15%.

**CRIAÇÃO DO QUANTITAS FIF MULT GALÁPAGOS**

(juros e inflação)

**2018**

**INÍCIO DA DISTRIBUIÇÃO DE FUNDOS DA QUANTITAS EM PLATAFORMAS DE INVESTIMENTO**

**2019**

**CRIAÇÃO DO QUANTITAS FIF MULT MALDIVAS L&S**

(long short neutro de ações)

**FORTE EXPANSÃO EM PLATAFORMAS E CLIENTES INSTITUCIONAIS**

**DESTAQUE NO RANKING TOP 5 ANUAL DO BCB:**  
1º LUGAR EM IPCA CP/MP  
2º LUGAR EM IPCA LP  
3º LUGAR EM SELIC CP

**2021**

**2023**

**CRIAÇÃO DO QUANTITAS FIF MULT CAPRI PREV**

(previdência inspirado no multiestratégia Mallorca)

**2024**

**CRIAÇÃO DO QUANTITAS FIF RF FIJI CP**

(crédito privado)

**2025**

**CRIAÇÃO DO QUANTITAS FIF SISTEMÁTICO NAXOS**

(quant + arbitragem)



# ORGANOGRAMA

**COMITÊ DE RISCO  
E COMPLIANCE**

**COMITÊ EXECUTIVO  
(DIRETORIA)**

**COMITÊ DE INVESTIMENTOS  
EM CRÉDITO PRIVADO**

**GESTÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO**

**RELAÇÕES COM INVESTIDORES  
E BACKOFFICE**

**RISCO, COMPLIANCE  
E ADMINISTRATIVO**

**(MM/RF) ROGÉRIO BRAGA** ■ ■

**(RV/LS/CP) WAGNER SALAVERRY** ■ ■

**(CP/LS) MARCEL KUSSABA** ■ ■

**LOUISE SCHEID** ■

**DANIELA ALLIATTI** ■

(MM/RF) MATHEUS GALLINA ■ ■  
 (MM/QUANT) JOÃO PEDRO OLIVEIRA ■ ■ ■  
 (QUANT) KEVIN PERGHER ■ ■  
 (QUANT) VINICIUS TREVELIN  
 (ECO/MM/RF) IVO CHERMONT ■ ■  
 (ECO/MM/RF) JOÃO FERNANDES ■ ■ ■  
 (ECO) ANDREI MITIDIERI

(RV/LS/CP) VINICIUS PICCININI ■ ■  
 (RV/LS) NICOLAS HENDGES ■

(CP) MATHEUS BRACK ■ ■  
 (CP) FREDERICO VALENTE ■  
 (CP) IGOR MACCARI ■

LAUREM LIMA  
 JERUSA PEREIRA  
 FRANCIELE JESUS

PEDRO CERVO ■  
 VINICIUS GIBROWSKI  
 LUIZ GOMES  
 JOÃO SALAVERRY  
 EDUARDO ZUCOLO  
 RENATO PERRONE  
 HEITOR SIAS  
 SOFIA SULZBACH  
 BIANCA BATTISTI

DANTE PAGLIARINI  
 TOBIAS MARION

■ SÓCIO ■ CFA ■ CGA

RF = RENDA FIXA | CP = CRÉDITO PRIVADO | MM = MULTIMERCADOS | QUANT = QUANTITATIVO | ECO = ECONOMIA | RV = RENDA VARIÁVEL | LS = LONG&SHORT





# Quantitas

## **FIF MULT SIST. NAXOS RL**



# EQUIPE



## ROGÉRIO BRAGA

- **22 anos em gestão de recursos**, com passagens por Auditoria (EY) e Tesouraria (Banco Sicredi) antes da Quantitas
- **Sócio responsável** pela gestão de Renda Fixa e Multimercados na Quantitas desde a fundação (2011).
- **Ex PM da Asset do Sicredi**, onde liderou fundos de Renda Fixa e Multimercados com **mais de R\$ 20 bilhões sob gestão**.



## JOÃO PEDRO

- **Sócio da Quantitas e trader de multimercados**
- Atua na **linha de frente do desenvolvimento, execução e controle** de estratégias quantitativas
- **Atua no desenvolvimento de algoritmos de trading e execução** (renda variável e juros) para o time quantitativo.
- Trader de renda variável em books discricionários dentro do Quantitas Mallorca
- Possui certificação CGA



## KEVIN PERGHER

- **Sócio da Quantitas e trader quantitativo**
- **Especialista em Research** (Estatística, Machine Learning e Ciência de Dados) e implementação de estratégias.
- **Atua no desenvolvimento** de sistemas internos, pipelines de dados e algoritmos de otimização no time quantitativo.
- **Engenheiro Físico e mestrando** em Ciências da Computação (UFRGS) com certificação CGA

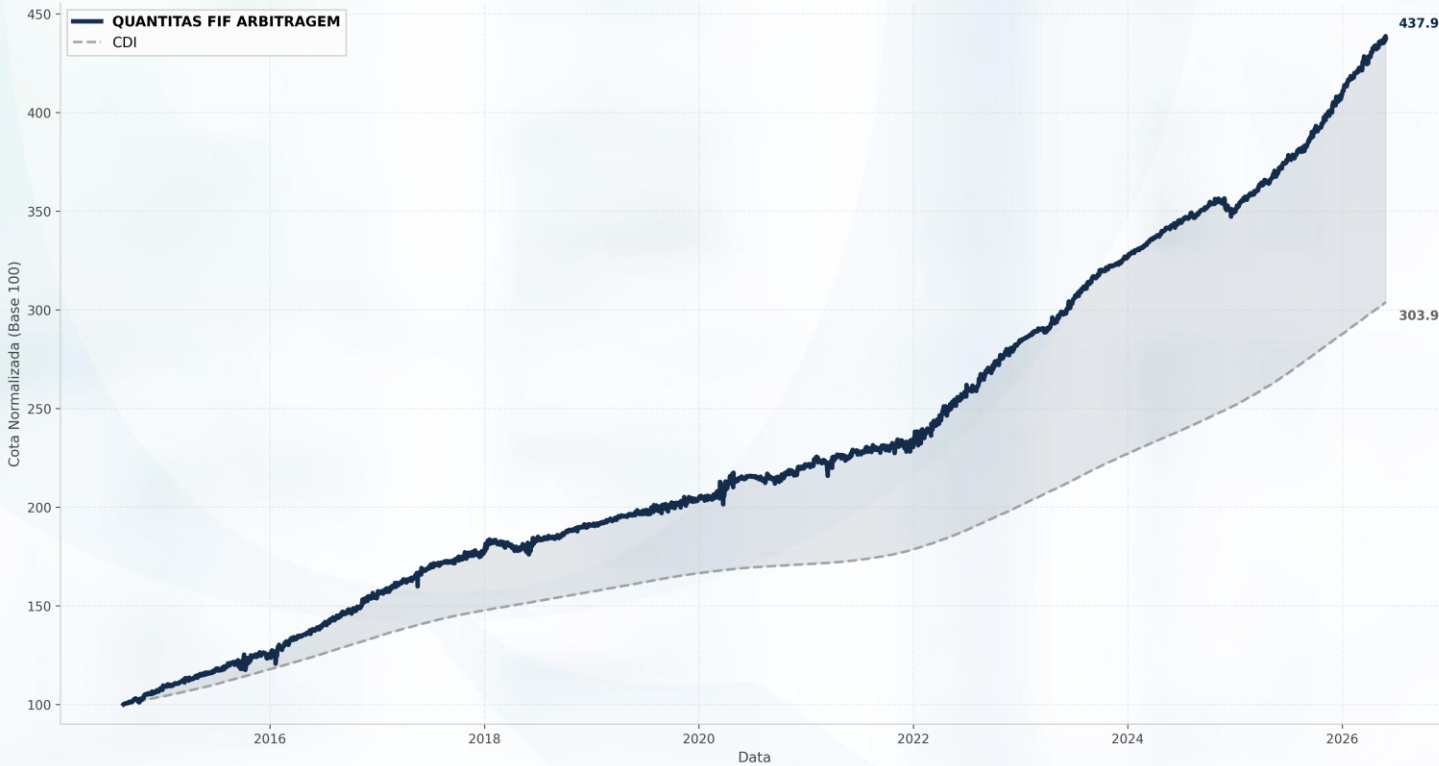


## VINÍCIUS TREVELIN

- **Trader Quantitativo**
- **Atua no desenvolvimento de estratégias quantitativas e sistemas**, com ênfase em infraestrutura de tecnologia, dados, nuvem e automação.
- **Foco no research de Equity Factors** no mercado brasileiro.
- **Engenheiro de Controle e Automação (UFRGS)** com certificação CGA

# ESTRATÉGIAS – QUANTITAS ARBITRAGEM

QUANTITAS FIF ARBITRAGEM vs CDI — Base 100



QUANTITAS FIF ARBITRAGEM — Estatísticas

		Fundo
Retorno Acumulado desde 20/08/2014		337,92%
Retorno Acumulado em 2026		6,57%
Volatilidade Anualizada	Base Diária	8,24%
Volatilidade Anualizada	Base Mensal	3,63%
Índice de Sharpe	Base Diária	0,42
Índice de Sharpe	Base Mensal	0,94
Meses acima de 100% do DI		91
Meses entre 0% e 100% do DI		27
Meses negativos		23
Maior rentabilidade mensal		4,00%
Menor rentabilidade mensal		-1,33%
Anos positivos		11
Anos negativos		0
CAGR		13,37%

\*Data da última cota: 29/05/2026



# RESULTADO REALIZADO – BOOKS QUANTITATIVOS

QUANTS MALLORCA vs CDI – Base 100

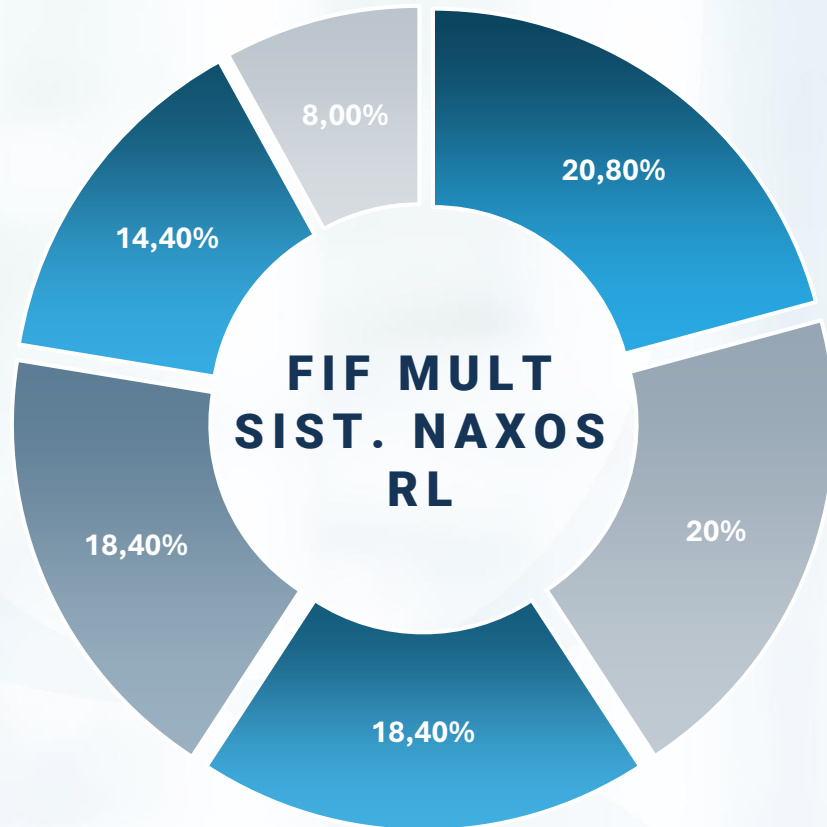


\*Volatilidade normalizada para 5% - Descontado de ADM

\*Data da última cota: 29/05/2026



# DISTRIBUIÇÃO DO PORTFÓLIO ATUAL



- QUANT\_TO
- QUANT\_MA
- QUANT\_GO
- QUANT\_BA
- QUANT\_DF
- ARBITRAGEM

Risco	Segmento	Porcentagem	Descrição
80% RISCO	QUANT_TO	20,8%	<b>Trend Follower estrutural.</b> Utiliza otimizações cruzadas de métricas técnicas de mercado para criar um índice de <b>momentum</b> .
	QUANT_MA	18,4%	<b>Trend Follower agressivo.</b> Utiliza algoritmos de Machine Learning para identificar componentes de <b>aceleração</b> em ativos e setores.
	QUANT_BA	14,4%	<b>Estratégia de fatores</b> que explora o prêmio existente entre os <b>betas</b> das ações da bolsa brasileira.
	QUANT_GO	18,4%	<b>Quantitativo Fundamentalista.</b> Utiliza algoritmos de Machine Learning para identificar <b>padrões fundamentalistas</b> .
	QUANT_DF	8%	<b>Estratégia de fatores</b> que busca montar carteiras <b>multifatoriais</b> otimizadas.
20% RISCO	ARBITRAGEM	20%	<b>Estratégia de valor relativo</b> que opera <b>convexidade</b> na curva de juros brasileira.

# QUANTITAS FIF MULT SIST. NAXOS RL



Processo de investimento **sistemático/quantitativo**



**Sem inputs de cenário** macroeconômico



**Descorrelacionado** da indústria de fundos e dos mercados



**Volatilidade moderada** em relação aos peers (target 5% a.a.)



# Subclasse II Quantitas

## FIF MULT SIST. NAXOS RL

CNPJ da classe: 63.459.498/0001-75 | Data de início da subclasse II: 12/11/2025 | Código CVM: 422754 | Código identificador: JIXPI1761934182

Estrutura de subclasse II do fundo multimercado sistemático, que opera estratégias quantitativas combinadas com exposição de risco em operações de convexidade na curva de juros (Quantitas Mult Arbitragem).

### Objetivo de retorno

CDI+ 4% a.a.

### Mercados de alocação

Quantitativo + Juros

### Objetivo de volatilidade anual

5% a.a.

### Taxa global

1,80% a.a.

### Taxa de performance

20% sobre o que exceder 100% do CDI

### Aplicação inicial mínima

R\$ 1.000,00

### Movimentação mínima

R\$ 1.000,00

### Valor de permanência no fundo

R\$ 1.000,00

### Cotização do resgate

D+14 dias corridos

### Liquidação do resgate

D+1 dia útil após a cotização

# Subclasse II Quantitas

## FIF MULT SIST. NAXOS RL

CNPJ da classe: 63.459.498/0001-75 | Data de início da subclasse II: 12/11/2025 | Código CVM: 422754 | Código identificador: JIXPI1761934182

12/11/2025 (aporte inicial)

Quantitas FIM Master

Subclasse I Quantitas Naxos

**PATRIMÔNIO LÍQUIDO  
DA CLASSE DE FUNDO**

12/11/2025 (abertura a mercado)

Investidores/mercado

Subclasse II Quantitas Naxos\*

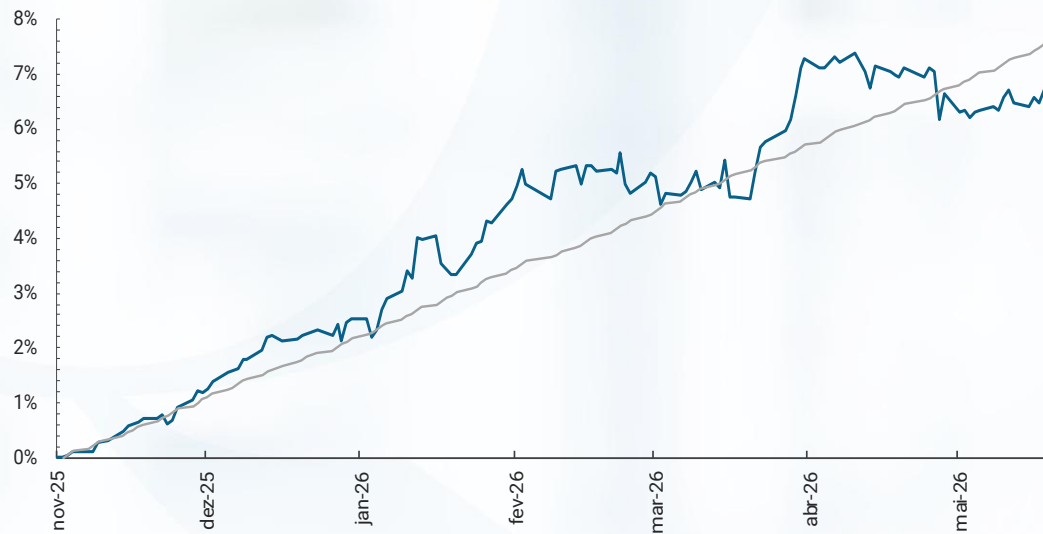
PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL\*

**R\$ 33.379.250,71**

Data-base: 29/05/2026 | Fonte: Intrag  
\*PL desconsidera come-cotas 2026/1

# SUB II QUANTITAS FIF MULT SIST. NAXOS RL

EVOLUÇÃO DE RENTABILIDADE



**PATRIMÔNIO LÍQUIDO  
SUBCLASSE II**

PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL

**R\$ 941.615,59**

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO\*

**R\$ 873.206,23**

Data-base: 29/05/2026 | Fonte: Intrag | \*12 meses

\*PL desconsidera come-cotas 2026/1

# SUB II QUANTITAS FIF MULT SIST. NAXOS RL

TABELA DE RENTABILIDADE

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acumulado
2025	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,70%	1,54%	2,26%	2,26%
	% CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	115,42%	126,61%	122,98%	122,98%
	DI +	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,09%	0,32%	0,42%	0,42%
2026	Fundo	1,05%	1,84%	0,01%	1,77%	-0,02%	-	-	-	-	-	-	-	4,72%	7,08%
	% CDI	90,06%	184,40%	1,11%	162,18%	-2,02%	-	-	-	-	-	-	-	83,33%	93,16%
	DI +	-0,12%	0,84%	-1,20%	0,68%	-1,10%	-	-	-	-	-	-	-	-0,94%	-0,52%



Faça parte da nossa  
comunidade do WhatsApp



[quantitas.com.br](https://quantitas.com.br)



Quantitas Gestão de Recursos



[/QuantitasGestaodeRecursos](https://www.instagram.com/QuantitasGestaodeRecursos)



[investidores@quantitas.com.br](mailto:investidores@quantitas.com.br)



+55 51 9 9656-9763



+55 51 3394-2330

# Quantitas

Regulamentos e lâminas dos fundos  
disponíveis em [quantitas.com.br/documentos](https://quantitas.com.br/documentos)

Material de divulgação elaborado pela Quantitas. Todos os direitos reservados ©

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.



ANBIMA