

# QUANTITAS FIM ARBITRAGEM

CNPJ: 20.077.711/0001-71 | Código ANBIMA: 375004 | Código ISIN: BRQT6CTF009 | Código Bloomberg: ARBTRLP BZ Equity

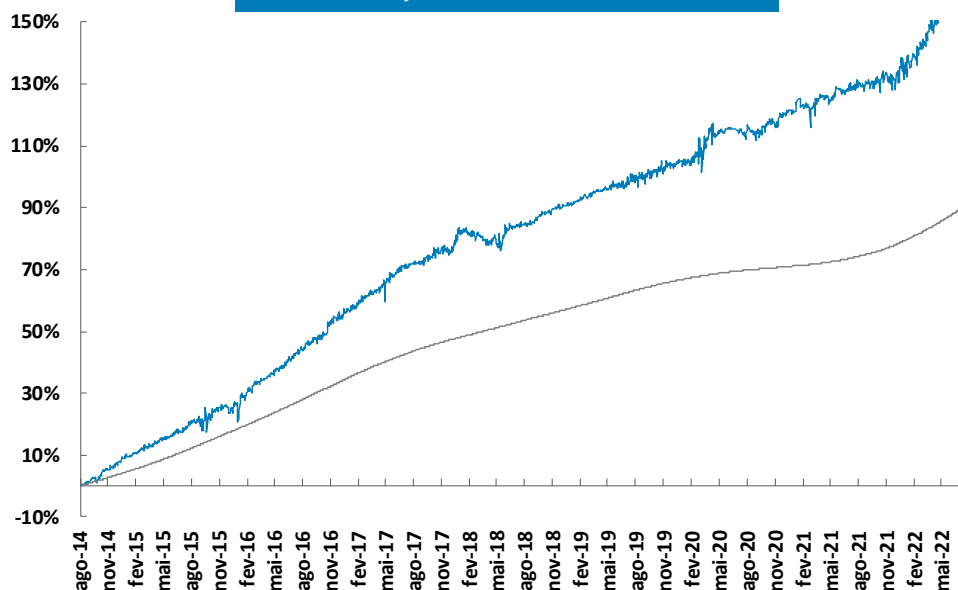
Fundo de Investimento Multimercado Arbitragem é destinado a Investidores Qualificados. O fundo busca retornos acima do CDI através de operações no mercado de juros local.

A estratégia é caracterizada por conter **uma carteira 100% em títulos públicos federais (sem risco de crédito privado)**, utilizar unicamente contratos de juros futuros da BM&F, ter baixa exposição às decisões correntes do Banco Central e possuir baixa correlação com movimentos direcionais da curva de juros, dólar, bolsa, bem como outros fundos multimercados.

## TABELA DE RENTABILIDADES

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acumulado
2014	Fundo	-	-	-	-	-	-	-	0,52%	2,52%	1,77%	0,55%	1,79%	7,36%	7,36%
	% CDI	-	-	-	-	-	-	-	181,88%	280,33%	187,59%	66,16%	188,10%	184,71%	184,71%
	DI +	-	-	-	-	-	-	-	0,23%	1,62%	0,83%	-0,28%	0,84%	3,37%	3,37%
2015	Fundo	2,39%	1,03%	1,85%	1,44%	1,13%	1,51%	0,53%	2,59%	-0,20%	2,61%	1,22%	-0,44%	16,78%	25,37%
	% CDI	258,10%	125,94%	178,54%	152,00%	115,33%	142,03%	45,04%	233,96%	-17,81%	235,53%	115,68%	-37,80%	126,87%	143,05%
	DI +	1,47%	0,21%	0,81%	0,49%	0,15%	0,45%	-0,65%	1,48%	-1,30%	1,50%	0,17%	-1,60%	3,55%	7,64%
2016	Fundo	3,02%	1,31%	2,12%	1,46%	1,55%	2,25%	1,68%	1,97%	1,27%	0,67%	3,09%	0,30%	22,71%	53,84%
	% CDI	285,95%	131,17%	182,70%	138,21%	139,63%	194,06%	151,68%	162,06%	114,46%	64,13%	297,63%	26,41%	162,18%	157,33%
	DI +	1,96%	0,31%	0,96%	0,40%	0,44%	1,09%	0,57%	0,75%	0,16%	-0,38%	2,05%	-0,83%	8,71%	19,62%
2017	Fundo	2,93%	1,12%	2,04%	-0,47%	4,00%	0,03%	0,63%	1,17%	0,99%	-0,06%	2,43%	-0,83%	14,78%	76,59%
	% CDI	269,16%	129,47%	194,48%	-59,81%	432,52%	3,11%	78,78%	145,83%	154,46%	-9,37%	429,02%	-153,73%	148,55%	160,96%
	DI +	1,84%	0,26%	0,99%	-1,26%	3,08%	-0,79%	-0,17%	0,37%	0,35%	-0,71%	1,87%	-1,37%	4,83%	29,01%
2018	Fundo	3,70%	-0,99%	-0,26%	-1,04%	-0,06%	3,07%	0,02%	0,28%	0,55%	1,31%	0,95%	0,35%	8,03%	90,77%
	% CDI	633,75%	-211,56%	-49,72%	-200,86%	-10,92%	592,72%	3,67%	48,95%	116,47%	240,73%	192,24%	70,23%	125,03%	159,07%
	DI +	3,11%	-1,45%	-0,80%	-1,56%	-0,57%	2,55%	-0,52%	-0,29%	0,08%	0,76%	0,46%	-0,15%	1,61%	33,71%
2019	Fundo	0,57%	0,77%	0,66%	0,34%	1,15%	0,16%	0,65%	1,02%	0,60%	-1,26%	2,41%	-0,22%	7,02%	104,17%
	% CDI	104,65%	155,16%	141,60%	65,98%	211,02%	33,76%	115,34%	202,17%	128,22%	-261,02%	633,91%	-59,00%	117,68%	156,80%
	DI +	0,03%	0,27%	0,20%	-0,18%	0,60%	-0,31%	0,09%	0,51%	0,13%	-1,74%	2,03%	-0,60%	1,06%	37,73%
2020	Fundo	0,76%	0,61%	1,73%	1,38%	0,58%	0,42%	-0,47%	-0,07%	-0,76%	2,41%	-0,71%	1,98%	8,06%	120,63%
	% CDI	200,47%	207,19%	507,53%	483,81%	241,39%	195,96%	-243,84%	-45,40%	-486,40%	1536,67%	-474,27%	1203,53%	291,35%	169,80%
	DI +	0,38%	0,32%	1,39%	1,09%	0,34%	0,21%	-0,67%	-0,23%	-0,92%	2,26%	-0,86%	1,81%	5,30%	49,59%
2021	Fundo	1,55%	-0,42%	0,96%	-0,26%	0,60%	0,51%	0,88%	0,18%	0,37%	-1,33%	1,47%	-0,14%	4,43%	130,40%
	% CDI	1035,88%	-309,48%	483,36%	-124,08%	224,87%	166,85%	248,00%	42,33%	84,45%	-276,61%	251,38%	-18,56%	100,76%	165,99%
	DI +	1,40%	-0,55%	0,76%	-0,47%	0,33%	0,20%	0,53%	-0,24%	-0,07%	-1,81%	0,89%	-0,91%	0,03%	51,84%
2022	Fundo	3,90%	-0,21%	3,15%	1,40%	2,34%	0,13%	1,60%	-	-	-	-	-	12,92%	160,17%
	% CDI	532,62%	-27,61%	340,90%	168,24%	226,77%	13,28%	155,07%	-	-	-	-	-	198,99%	177,67%
	DI +	3,17%	-0,96%	2,22%	0,57%	1,31%	-0,88%	0,57%	-	-	-	-	-	6,43%	70,02%

## EVOLUÇÃO DA RENTABILIDADE



## EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO \*12 MESES

PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL

**R\$ 210.890.527,49**

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO\*

**R\$ 230.881.806,27**

DATA-BASE: 29/07/2022 | FONTE: INTRAG

## INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

- Aplicação inicial mínima: R\$ 50.000,00
- Movimentação mínima: R\$ 5.000,00
- Valor de permanência no fundo: R\$ 25.000,00
- Taxa de administração: 0,985% a.a.
- Taxa de performance: 20% sobre o que exceder 100% do CDI
- Classificação ANBIMA: Multimercado Estratégia Específica

- Benchmarking: CDI
- Cotização da Aplicação: D+0
- Liquidação da Aplicação: D+0
- Cotização do Resgate: D+14 dias corridos
- Liquidação do Resgate: D+1 dia após a cotização

- Horário limite movimentação: até 15h (dia útil)
- Perfil de Risco: Moderado
- Tributação: Longo Prazo
- Data de Início: 20/08/2014

# QUANTITAS FIM ARBITRAGEM

CNPJ: 20.077.711/0001-71 | Código ANBIMA: 375004 | Código ISIN: BRQT6CTF009 | Código Bloomberg: ARBTRLP BZ Equity

## DADOS ESTATÍSTICOS HISTÓRICOS

	Fundo	CDI
Retorno Acumulado desde 20/08/2014	160,17%	90,15%
Retorno Acumulado em 2022	12,92%	6,49%
Volatilidade Anualizada	Base Diária	9,64%
	Base Mensal	4,08%
Índice de Sharpe	Base Diária	0,46
	Base Mensal	1,07
Meses acima de 100% do DI	62	
Meses entre 0% e 100% do DI	14	
Meses negativos	20	
Maior rentabilidade mensal	4,00%	
Menor rentabilidade mensal	-1,33%	

## ESTRUTURA

GESTOR

Quantitas

ADMINISTRADOR

Intrag  
uma empresa Itaú

CUSTODIANTE

Itaú

AUDITOR

Deloitte.

# Quantitas

Comprometidos com o seu futuro.



As informações contidas neste documento foram produzidas pela Quantitas Gestão de Recursos S.A. dentro das condições atuais de mercado e conjuntura. Todas as recomendações e estimativas aqui apresentadas derivam de nosso julgamento e podem ser alteradas a qualquer momento sem aviso prévio. \*\*A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. 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 investimentos não contam com a garantia do administrador, gestor, de qualquer mecanismo de seguro ou fundo garantidor de crédito - FGC. A Quantitas Gestão de Recursos S.A. não se responsabiliza por decisões de investimento 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.