QUANTITAS FIF MULT ARBITRAGEM LP RESP. LIMITADA

CNPJ: 20.077.711/0001-71

CÓDIGO ANBIMA: 375004

CÓDIGO ISIN: BRQTT6CTF009

CÓDIGO BLOOMBERG: ARBTRLP BZ Equity

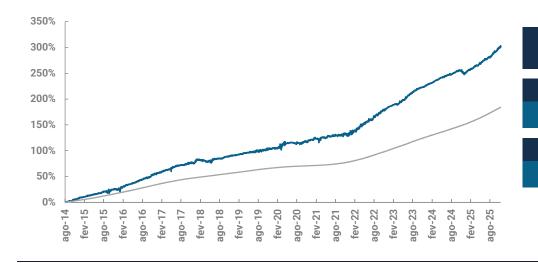
O Quantitas FIF Mult. Arbitragem LP RL é destinado a Investidores Qualificados e busca retornos acima do CDI através de operações no mercado de juros local exclusivamente.

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 RENTABILIDADE

| | | 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% | 2,90% | 0,85% | 2,08% | 1,58% | 1,63% | 23,49% | 184,52% |
| | % CDI | 532,62% | -27,61% | 340,90% | 168,24% | 226,77% | 13,28% | 155,07% | 248,45% | 79,65% | 203,31% | 154,52% | 145,24% | 189,83% | 183,32% |
| | DI + | 3,17% | -0,96% | 2,22% | 0,57% | 1,31% | -0,88% | 0,57% | 1,73% | -0,22% | 1,05% | 0,56% | 0,51% | 11,11% | 83,87% |
| 2023 | Fundo | 0,79% | 0,80% | 0,00% | 1,83% | 1,38% | 2,34% | 1,74% | 1,48% | 1,09% | 1,13% | 0,16% | 1,04% | 14,65% | 226,20% |
| | % CDI | 70,26% | 86,82% | -0,41% | 199,50% | 123,04% | 218,12% | 162,12% | 129,71% | 112,33% | 113,20% | 17,42% | 116,17% | 112,29% | 178,35% |
| | DI + | -0,33% | -0,12% | -1,18% | 0,91% | 0,26% | 1,27% | 0,67% | 0,34% | 0,12% | 0,13% | -0,76% | 0,14% | 1,60% | 99,37% |
| 2024 | Fundo | 1,21% | 0,83% | 1,08% | 1,01% | 0,72% | 0,82% | 0,62% | 0,55% | 0,96% | 0,66% | -0,99% | -0,38% | 7,31% | 250,04% |
| | % CDI | 124,96% | 103,97% | 129,00% | 114,16% | 86,93% | 104,13% | 68,55% | 62,99% | 115,10% | 71,02% | -124,53% | -40,86% | 67,22% | 165,05% |
| | DI+ | 0,24% | 0,03% | 0,24% | 0,13% | -0,11% | 0,03% | -0,29% | -0,32% | 0,13% | -0,27% | -1,78% | -1,31% | -3,56% | 98,55% |
| 2025 | Fundo | 1,94% | 0,47% | 1,37% | 0,68% | 1,63% | 1,23% | 1,01% | 0,74% | 1,82% | 1,65% | 1,76% | | 15,25% | 303,43% |
| | % CDI | 192,27% | 47,56% | 143,15% | 64,78% | 143,14% | 111,77% | 79,41% | 63,67% | 149,23% | 129,01% | 166,94% | - | 117,90% | 164,88% |
| | DI+ | 0,93% | -0,52% | 0,41% | -0,37% | 0,49% | 0,13% | -0,26% | -0,42% | 0,60% | 0,37% | 0,70% | - | 2,32% | 119,40% |

EVOLUÇÃO E RENTABILIDADE



EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO 12 MESES

PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL

R\$ 263.829.976,12

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO

R\$ 247.631.420,69

DATA-BASE: 28/11/2025 | FONTE: INTRAG

^{*} PL atual, desconsiderando o come-cotas

CNPJ: 20.077.711/0001-71

CÓDIGO ANBIMA: 375004

CÓDIGO ISIN: BRQTT6CTF009

CÓDIGO BLOOMBERG: ARBTRLP BZ Equity

DADOS ESTATÍSTICOS HISTÓRICOS

| | | Fundo | CDI | |
|------------------------------------|--------------------------|---------|-----|--|
| Retorno Acumulado desde 20/08/2014 | 303,43% | 184,03% | | |
| Retorno Acumulado em 2025 | 15,25% | 12,94% | | |
| Volatilidade Anualizada | Base Diária | 8,37% | | |
| Volatilidade Alfualizada | Base Mensal | 3,68% | | |
| Índice de Sharpe | Base Diária | 0,42 | | |
| mulce de Sharpe | Base Mensal | 0,93 | | |
| Meses acima de 100% do DI | eses acima de 100% do DI | | | |
| Meses entre 0% e 100% do DI | 26 | | | |
| Meses negativos | 23 | | | |
| Maior rentabilidade mensal | 4,00% | | | |
| Menor rentabilidade mensal | -1,33% | | | |

ESTRUTURA

GESTOR

Quantitas

ADMINISTRADOR



CUSTODIANTE



AUDITOR

Deloitte.

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 Global: 0.985% a.a.
- Taxa de performance: 20% sobre o que exceder 110% do CDI
- Classificação ANBIMA: Multimercado Estratégia Específica
- · Benchmark: 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



Regulamentos e lâminas dos fundos disponíveis em quantitas.com.br/documentos



quantitas.com.br



in Quantitas Gestão de Recursos



/QuantitasGestaodeRecursos



investidores@quantitas.com.br



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. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.