

# SUBCLASSE II - QUANTITAS SISTEMÁTICO NAXOS FIF MULT RL

CNPJ: 63.459.498/0001-754

CÓDIGO CVM: JIXPI1761934182

CÓDIGO ISIN: BR00Q8GCTF001

O Quantitas FIF Multi Sistemático Naxos é caracterizado por combinar estratégias quantitativas com operações de arbitragem e convexidade na curva de juros, reduzindo a dependência da rentabilidade aos movimentos direcionais dos mercados. O fundo busca retornos consistentes por meio de modelos estatísticos e sistemáticos, sem depender de decisões de cenário macroeconômico tradicionais.

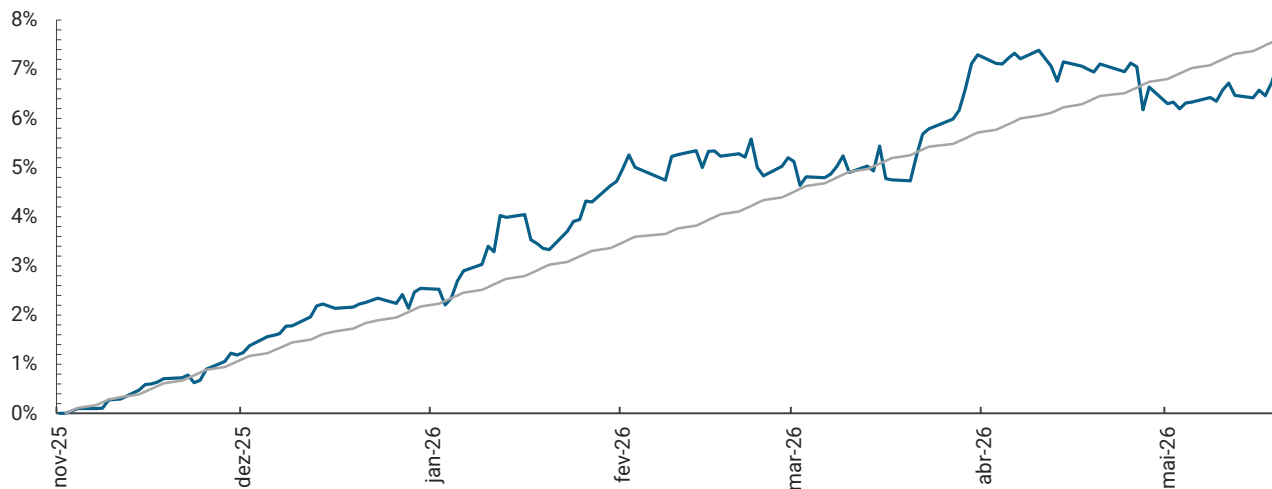
Atualmente, a maior parte da carteira está alocada em estratégias quantitativas de long short de ações, além de estratégias de arbitragem. Novas estratégias poderão ser desenvolvidas nos mercados de ações, juros e câmbio. O conjunto de estratégias descorrelacionadas contribui para diversificação, volatilidade moderada e consistência de resultados ao longo do tempo

O fundo é estruturado em 2 subclasses, sendo que a subclasse II é destinada ao mercado.

## 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%

## EVOLUÇÃO E RENTABILIDADE



## EVOLUÇÃO DO PL - 12 MESES

	PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL	PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO
Subclasse II	R\$ 941.615,59	R\$ 873.206,23
Classe	R\$ 33.379.250,71	R\$ 32.395.755,84

DATA-BASE: 29/05/2026 | FONTE: INTRAG

\* PL atual, desconsiderando o come-cotas

## INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES

- Aplicação inicial mínima: R\$ 1.000,00
- Movimentação mínima: R\$ 1.000,00
- Valor de permanência no fundo: R\$ 1.000,00
- Taxa Global: 1,80% a.a.
- Taxa de performance: 20% do que exceder 100% do CDI
- Clas. ANBIMA: Multimercados Macro
- Benchmark: CDI
- Cotização da Aplicação: D+0
- Liquidação da Aplicação: D+0
- Cotização do Resgate: D+14 (corridos)
- Liquidação do Resgate: D+1 dia útil após a cotização
- Horário limite movimentação: até 15h (dia útil)
- Perfil de Risco: Moderado
- Data de início da subclasse II: 12/11/2025

## DADOS ESTATÍSTICOS HISTÓRICOS

	Fundo	CDI
Retorno Acumulado desde 12/11/2025	7,08%	7,60%
Retorno Acumulado em 2026	4,72%	5,66%
Volatilidade Anualizada	Base Diária	3,62%
	Base Mensal	2,72%
Índice de Sharpe	Base Diária	-0,28
	Base Mensal	-0,29
Meses acima de 100% do DI	4	
Meses entre 0% e 100% do DI	2	
Meses negativos	1	
Maior rentabilidade mensal	1,84%	
Menor rentabilidade mensal	-0,02%	

## ESTRUTURA

GESTOR

Quantitas

ADMINISTRADOR

Intrag  
uma empresa Itaú

CUSTODIANTE

Itaú

AUDITOR

pwc

Quantitas

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

 [quantitas.com.br](https://quantitas.com.br)
 Quantitas Gestão de Recursos
  /QuantitasGestaodeRecursos
  [investidores@quantitas.com.br](mailto: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.