

Quantitas

INSTITUCIONAL

QUEM SOMOS



GESTÃO DE FUNDOS



RENDA FIXA

4 fundos



MULTIMERCADOS

5 fundos



AÇÕES LONG-ONLY

1 fundo

LINHA DO TEMPO



ÉQUIPE

ORGANOGRAMA



RF E MULTIMERCADOS



ANÁLISE RV E CRÉDITO



WAGNER SALAVERRY ■■

GESTÃO LONG ONLY



MARCEL KUSSABA ■■■

GESTÃO LONG SHORT
E ANÁLISE DE CRÉDITO



VINICIUS PICCININI ■■



NICOLAS HENGES



SARA ROCHA



MATHEUS BRACK ■■



FREDERICO VALENTE ■■



IGOR MACCARI ■■

■ SÓCIO ■ CFA ■ CGA



FUNDOS DE INVESTIMENTOS

CLASSE CVM	FUNDOS DE INVESTIMENTOS	ESTRATÉGIA	PÚBLICO-ALVO
RENDA FIXA	QUANTITAS FIF RF ATIVO MALTA RL	ESTRATÉGIA DE JUROS LOCAL E INFLAÇÃO	PESSOAS FÍSICAS, JURÍDICAS, FUNDOS DE INVESTIMENTOS E EFPC'S (4994)
	QUANTITAS FIF RF FIJI CP RL	CRÉDITO PRIVADO MID GRADE	INVESTIDORES QUALIFICADOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS
	QUANTITAS FIF RF UBR III RL	CRÉDITO PRIVADO HIGH GRADE	MANDATO EXCLUSIVO DE CLIENTE INSTITUCIONAL (NÃO DISPONÍVEL PARA APLICAÇÕES)
MULTIMERCADOS	QUANTITAS FIF MULT QP3 RL	CRÉDITO PRIVADO HIGH GRADE	MANDATO EXCLUSIVO DE CLIENTE INSTITUCIONAL (NÃO DISPONÍVEL PARA APLICAÇÕES)
	QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA RL	MULTIESTRATÉGIAS EM JUROS, CÂMBIO E BOLSA	PESSOAS FÍSICAS, JURÍDICAS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS
	QUANTITAS FIF MULT CAPRI PREV FIFE RL	MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	PLANOS PGBL/VGBL POR MEIO DE SEUS FUNDOS EXCLUSIVOS E PESSOAS FÍSICAS VIA PLATAFORMAS
	QUANTITAS FIF MULT GALÁPAGOS RL	ESTRATÉGIA DE JUROS LOCAL E INFLAÇÃO	PESSOAS FÍSICAS, JURÍDICAS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS
	QUANTITAS FIF MULT ARBITRAGEM RL	ESTRATÉGIAS DE CONVEXIDADE NA CURVA DE JUROS	INVESTIDORES QUALIFICADOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS
	QUANTITAS FIF MULT MALDIVAS LS RL	LONG-SHORT DE AÇÕES	PESSOAS FÍSICAS, JURÍDICAS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS
AÇÕES	QUANTITAS FIFA MONTECRISTO RL	LONG-ONLY DE AÇÕES	PESSOAS FÍSICAS, JURÍDICAS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

MAPA DE ESTRATÉGIAS DA CASA



SUBESTRATÉGIAS E RANGE TARGET DE RISCO NO FUNDO MALLORCA (EM SHARE DO VAR/STRESS)		MULTIESTRATÉGIA	PREVIDÊNCIA	MULTIMERCADO JUROS E INFLAÇÃO	RENDA FIXA ATIVO	RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	ARBITRAGEM DE JUROS	LONG & SHORT DE AÇÕES	LONG ONLY DE AÇÕES
		MALLORCA	CAPRI PREV ¹	GALÁPAGOS	MALTA	FIJI ⁵	ARBITRAGEM	MALDIVAS	MONTECRISTO
JUROS	CONVEXIDADE	5% - 10%	✓						
	PRÉ VALOR RELATIVO ²	20% - 30%	✓	✓	✓	✓			
	PRÉ DIRECIONAL		✓	✓	✓	✓			
	JUROS REAIS VALOR RELATIVO ²		✓	✓	✓	✓			
	JUROS REAIS DIRECIONAL		✓	✓	✓	✓			
	IPCA CP		✓		✓				
	INFLAÇÃO IMPLÍCITA LP		✓	✓	✓	✓			
CÂMBIO	VALOR RELATIVO MOEDAS	10% - 20%	✓	✓					
RENDA VARIÁVEL	DIRECIONAL ÍNDICE	20% - 30%	✓	✓					
	STOCK PICKING AÇÕES		✓	✓					
	TRADING OPÇÕES		✓	✓					
	LS MALDIVAS ³	5% - 15%	✓	✓				✓	
	LS MONTECRISTO ⁴		✓	✓					✓
QUANT.	4 SUBESTRATÉGIAS LS	5% - 10%	✓	✓					
CRÉDITO PRIVADO	MID GRADE (ATÉ 3% PL)	0% - 20% (DO PL)	✓	✓			✓		
	HIGH GRADE		✓	✓					

1. O QUANTITAS FIF MULT CAPRI PREV SE PROPÕE A REPLICAR AS ESTRATÉGIAS MAIS LÍQUIDAS DO QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA E É DESTINADO A RECEBER APORTES DOS PLANOS DE PREVIDÊNCIA DAS INSTITUIÇÕES.

2. PARA O QUANTITAS FIF MULT CAPRI PREV E O QUANTITAS FIF RF ATIVO MALTA, CONSIDERAR SOMENTE OS VÉRTICES MAIS LÍQUIDOS DESSAS ESTRATÉGIAS.

3. ESSA ESTRATÉGIA É UMA RÉPLICA DO FUNDO QUANTITAS FIF MULT MALDIVAS L&S DENTRO DO BOOK DE RENDA VARIÁVEL DO QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA.

4. ESSA ESTRATÉGIA É UMA RÉPLICA DO FUNDO QUANTITAS FIF MONTECRISTO COM HEDGE EM ÍNDICE FUTURO, PORTANTO ENTRA COMO L&S NO BOOK DE RENDA VARIÁVEL DO FUNDO QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA.

5. FUNDO DE CRÉDITO PRIVADO MID GRADE DESTINADO A INVESTIDORES QUALIFICADOS QUE SE PROPÕE A BUSCAR VALORIZAÇÃO POR MEIO DO INVESTIMENTO EM TÍTULOS CORPORATIVOS, BANCÁRIOS E FIDCs (LIMITADO A 40%PL).

Quantitas

FIF CIC MULT MALLORCA RL



Quantitas

FIF CIC MULT MALLORCA RL

CNPJ: 22.918.359/0001-85

CÓDIGO ANBIMA: 413259

CÓDIGO ISIN: BRQTTSCFT006

CÓDIGO BLOOMBERG: QUANTIFC BZ EQUITY

DATA DE INÍCIO: 22/02/2016

Fundo multimercado com múltiplas estratégias proprietárias nos mercados de juros, ações e moedas, caracterizado por limitada exposição em posições direcionais e perfil de risco moderado.

Objetivo de retorno

CDI+ 4% a.a.

Mercados de alocação

Juros, câmbio e bolsa

Objetivo de volatilidade anual

5%

Taxa global

1,8% 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

[Clique aqui](#) e acesse a página do fundo.



QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA RL

CNPJ: 22.918.359/0001-85

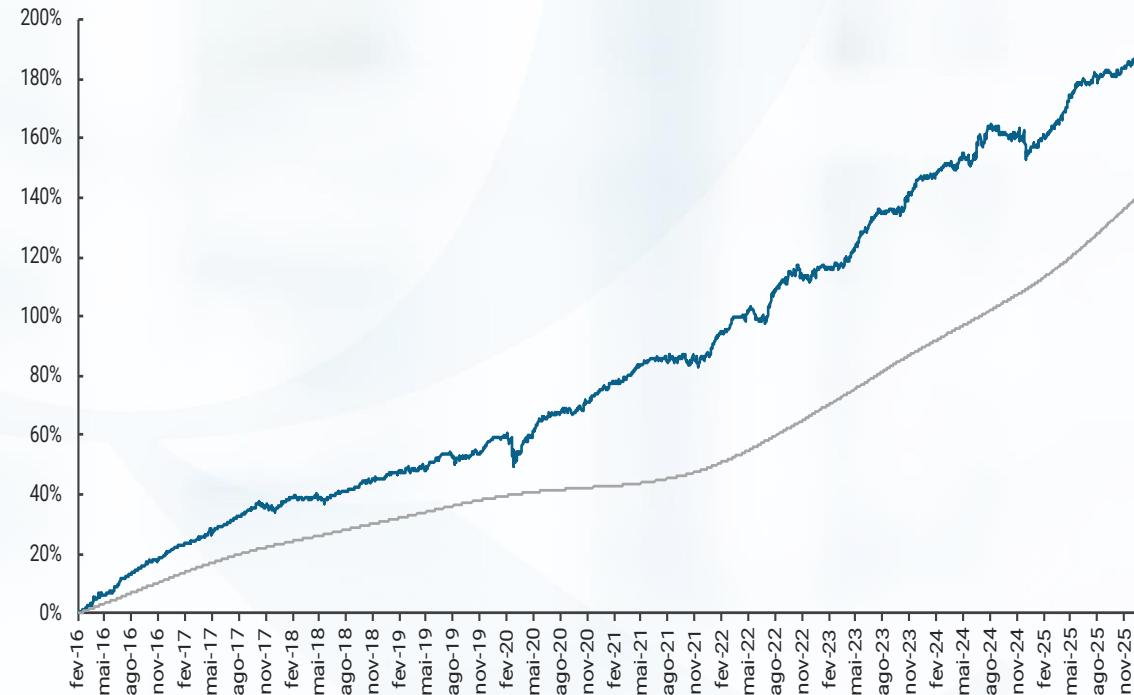
CÓDIGO ANBIMA: 413259

CÓDIGO ISIN: BRQTTSCTF006

CÓDIGO BLOOMBERG: QUANTIFC BZ EQUITY

DATA DE INÍCIO: 22/02/2016

EVOLUÇÃO DE RENTABILIDADE



EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO

* 12 MESES

PATRIMÔNIO LÍQUIDO ATUAL

R\$ 763.282.356,10

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO*

R\$ 912.258.582,48

Data-base: 31/12/2025 | Fonte: Intrag

QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA RL

CNPJ: 22.918.359/0001-85

CÓDIGO ANBIMA: 413259

CÓDIGO ISIN: BRQTTSCTF006

CÓDIGO BLOOMBERG: QUANTIFC BZ EQUITY

DATA DE INÍCIO: 22/02/2016

TABELA DE RENTABILIDADE

		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano	Acumulado
2016	Fundo	-	0,43%	2,47%	3,71%	0,14%	2,18%	2,77%	1,80%	1,41%	1,72%	0,85%	1,88%	21,10%	21,10%
	% CDI	-	164,93%	212,58%	351,72%	12,90%	187,56%	250,55%	148,17%	127,43%	164,50%	82,10%	167,05%	176,03%	176,03%
	DI +	-	0,17%	1,31%	2,65%	-0,96%	1,02%	1,67%	0,58%	0,30%	0,68%	-0,19%	0,75%	9,11%	9,11%
2017	Fundo	1,48%	0,58%	1,41%	0,48%	2,01%	1,16%	1,07%	1,41%	1,39%	1,27%	-0,94%	-0,23%	11,63%	35,18%
	% CDI	135,92%	66,55%	134,29%	61,06%	217,08%	142,83%	133,60%	175,68%	216,26%	197,07%	-164,79%	-42,35%	116,86%	152,10%
	DI +	0,39%	-0,29%	0,36%	-0,31%	1,08%	0,35%	0,27%	0,61%	0,75%	0,63%	-1,50%	-0,77%	1,68%	12,05%
2018	Fundo	2,20%	0,92%	-0,59%	0,41%	-0,62%	1,03%	0,61%	0,73%	0,58%	1,48%	0,71%	0,07%	7,77%	45,69%
	% CDI	377,82%	198,20%	-110,73%	80,00%	-120,25%	198,93%	113,33%	128,46%	123,47%	273,10%	144,40%	13,73%	121,01%	147,20%
	DI +	1,62%	0,46%	-1,12%	-0,10%	-1,14%	0,51%	0,07%	0,16%	0,11%	0,94%	0,22%	-0,43%	1,35%	14,65%
2019	Fundo	1,19%	0,43%	0,31%	0,42%	0,99%	0,95%	0,90%	-0,60%	0,31%	0,79%	0,60%	2,41%	9,03%	58,85%
	% CDI	219,02%	87,22%	66,18%	80,59%	183,00%	203,51%	159,00%	-119,80%	66,97%	164,05%	157,00%	641,18%	151,39%	151,45%
	DI +	0,65%	-0,06%	-0,16%	-0,10%	0,45%	0,49%	0,34%	-1,11%	-0,15%	0,31%	0,22%	2,04%	3,07%	19,99%
2020	Fundo	0,12%	-0,96%	-1,87%	3,27%	2,19%	1,64%	0,72%	0,51%	-0,36%	0,57%	2,31%	1,82%	10,29%	75,20%
	% CDI	32,25%	-325,93%	-550,94%	1146,16%	918,31%	761,24%	373,04%	315,42%	-230,95%	360,97%	1546,17%	1109,01%	371,75%	176,09%
	DI +	-0,26%	-1,26%	-2,22%	2,98%	1,95%	1,42%	0,53%	0,35%	-0,52%	0,41%	2,16%	1,66%	7,52%	32,49%
2021	Fundo	0,41%	0,93%	1,19%	1,54%	1,21%	0,66%	-0,13%	0,19%	0,10%	-1,49%	0,17%	2,32%	7,27%	87,93%
	% CDI	271,46%	691,13%	598,93%	739,61%	453,00%	215,84%	-35,20%	45,12%	22,26%	-311,08%	28,78%	303,64%	165,32%	179,53%
	DI +	0,26%	0,80%	0,99%	1,33%	0,94%	0,35%	-0,48%	-0,23%	-0,34%	-1,97%	-0,42%	1,55%	2,87%	38,95%
2022	Fundo	2,71%	0,92%	2,41%	0,23%	1,36%	-2,23%	2,75%	2,98%	1,00%	1,96%	-1,09%	0,94%	14,71%	115,56%
	% CDI	369,71%	123,36%	260,53%	27,92%	132,12%	-219,60%	265,59%	254,95%	93,43%	191,79%	-106,98%	83,49%	118,85%	171,43%
	DI +	1,98%	0,18%	1,48%	-0,60%	0,33%	-3,24%	1,71%	1,81%	-0,07%	0,94%	-2,11%	-0,19%	2,33%	48,15%
2023	Fundo	0,80%	-0,40%	0,49%	1,30%	2,19%	2,07%	2,08%	0,19%	0,34%	-0,08%	2,95%	1,88%	14,65%	147,14%
	% CDI	71,57%	-43,08%	41,98%	141,17%	194,55%	192,69%	193,98%	16,86%	34,71%	-7,79%	321,08%	210,10%	112,27%	164,86%
	DI +	-0,32%	-1,31%	-0,68%	0,38%	1,06%	0,99%	1,01%	-0,95%	-0,64%	-1,08%	2,03%	0,99%	1,60%	57,89%
2024	Fundo	0,25%	0,62%	0,99%	-0,64%	1,12%	0,07%	2,51%	1,32%	-0,64%	-0,29%	-0,36%	-1,63%	3,32%	155,35%
	% CDI	25,74%	77,86%	119,27%	-71,58%	134,99%	9,43%	276,73%	152,66%	-76,17%	-31,55%	-45,92%	-176,08%	30,56%	141,45%
	DI +	-0,72%	-0,18%	0,16%	-1,52%	0,29%	-0,71%	1,60%	0,46%	-1,47%	-1,22%	-1,15%	-2,56%	-7,55%	45,52%
2025	Fundo	1,36%	0,97%	1,44%	1,51%	2,39%	1,70%	-0,47%	0,82%	0,41%	-0,22%	1,07%	1,41%	13,07%	188,74%
	% CDI	134,39%	98,11%	149,48%	142,79%	210,02%	155,30%	-37,08%	70,81%	33,72%	-17,24%	101,81%	115,94%	91,34%	134,94%
	DI +	0,35%	-0,02%	0,48%	0,45%	1,25%	0,61%	-1,75%	-0,34%	-0,81%	-1,50%	0,02%	0,19%	-1,24%	48,87%

QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA RL

CNPJ: 22.918.359/0001-85

CÓDIGO ANBIMA: 413259

CÓDIGO ISIN: BRQTTSCTF006

CÓDIGO BLOOMBERG: QUANTIFC BZ EQUITY

DATA DE INÍCIO: 22/02/2016

ESTRATÉGIAS DE JUROS

DIRECIONAL	Juros nominais (PRÉ)	Posições direcionais na curva de juros nominais pré, explorando alta / queda da curva de juros. (EX1: comprar uma alta maior da Selic no próximo COPOM EX2: comprar o juro 2024 esperando um ciclo de alta maior EX3: comprar o juro 2028 esperando maior aversão a risco no mercado)	
	Juros reais (IPCA+)	Similar ao Pré-Direcional, mas aplicado à curva de juros reais (IPCA+)	
VALOR RELATIVO	Juros nominais (PRÉ)	Posições na curva de juros nominais pré explorando o valor de um vencimento relativo a outro (EX: comprar a inclinação entre 2024 e 2028)	
	Juros reais (IPCA+)	Similar ao Pré-Valor Relativo, mas aplicado à curva de juros reais (IPCA+)	
CONVEXIDADE	Juros nominais (PRÉ)	Semi-arbitragem de distorções na curva de juros nominais pré utilizando 3 vencimentos. (EX: comprar o juro até 2024, vender 2026 e comprar 2028)	
INFLAÇÃO	Implícita CP	Posições baseadas no cenário para o IPCA de curto prazo (EX1: comprar o IPCA do próximo mês EX2: comprar o IPCA do ano de 2023)	
	Implícita LP	Posições direcionais ou de valor relativo na inflação implícita de longo prazo (EX: comprar a inflação implícita entre 2026 e 2028 esperando maior aversão a risco no mercado)	

QUANTITAS FIF CIC MULT MALLORCA RL

CNPJ: 22.918.359/0001-85

CÓDIGO ANBIMA: 413259

CÓDIGO ISIN: BRQTTSCTF006

CÓDIGO BLOOMBERG: QUANTIFC BZ EQUITY

DATA DE INÍCIO: 22/02/2016

RENDÀ VARIÁVEL	CÂMBIO	Valor Relativo Moedas	Posições entre diferentes pares de moedas.	
	Direcional índice	Posições direcionais em índices futuros do mercado de ações.		
	Ações	Posições em ações específicas, com tomada de decisão pela equipe de gestão dos multimercados, com suporte de research da equipe de renda variável.		
	Trading Opções	Posições em estruturas de opções e volatilidade, englobando risco direcional e arbitragem de distorções na volatilidade implícita.		
	LS Fundamentalista	Estratégia L&S fundamentalista neutra a mercado (i.e. sem exposição direcional) composta por uma carteira long em ações e uma carteira short.		
	LS Vec	Estratégia composta por uma carteira de ações que replica as posições long Only do FIA Montecristo e uma posição short em índice futuro para neutralizar a exposição direcional de notional.		
QUANT	LS Quantitativo	Estratégia L&S de ações quantitativa neutra a mercado para arbitragem de distorções via modelagem estatística.		



Solicite acesso à nossa
comunidade de WhatsApp

-  quantitas.com.br
-  [Quantitas Gestão de Recursos](#)
-  [/QuantitasGestaodeRecursos](#)
-  investidores@quantitas.com.br
-  [+55 51 9 9656-9763](tel:+5551996569763)
-  [+55 51 3394-2330](tel:+555133942330)

Quantitas

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

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.

