

QUANTAMENTAL GEMS FIA

**OBJETIVO**

Nosso objetivo é superar o índice de Small Caps da B3, com menos volatilidade. A exposição do portfólio do fundo é bem diversificada e 100% direcional.

**POLÍTICA DE INVESTIMENTO**

O Fundo tem por objetivo proporcionar aos seus cotistas, a médio e longo prazo, ganhos de capital por meio do investimento de seus recursos primordialmente no mercado acionário.

**PÚBLICO ALVO**

Investidores em geral que busquem performance diferenciada e entendam a natureza e a extensão dos riscos envolvidos.

**INFORMAÇÕES DO FUNDO**

Categoria Anbima: Ações Livre  
 \*Início do Fundo: 30/12/2019  
 Tributação: 15% na fonte sobre o ganho nominal

**PATRIMÔNIO**

GEMS: R\$6.624.143,01  
 Médio/últimos 12 meses: \$4.954.422,11

**MOVIMENTAÇÕES**

Aplicação inicial: R\$ 100,00  
 Movimentações adicionais:  
 R\$ 100,00  
 Saldo mínimo: R\$ 100,00  
 Conversão de aplicação: D+1

**RESGATES**

Cotização: D+30 (corridos)  
 Pagamento: D+2 (2 dias úteis após a cotização)

**HORÁRIO DE MOVIMENTAÇÃO**

Até 14:30h

**TAXAS**

Taxa de Administração: 2% a.a.  
 Taxa de Performance: 20% do que exceder o índice Small Caps

**GESTOR**

Itaú Unibanco S.A.

**ADMINISTRADOR**

BTG Pactual Serviços Financeiros S.A.  
 DTVM

**AUDITOR**

KPMG Auditores Independentes

**CUSTODIANTE**

Banco BTG Pactual S.A.

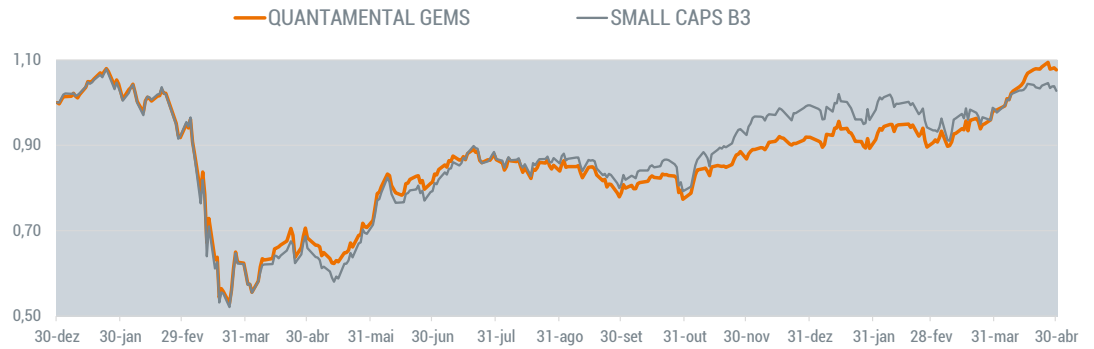
**■ ESTRATÉGIA LONG ONLY QUANTITATIVA**

O fundo tem como objetivo superar o SMLL, índice de Small Caps da B3, através da gestão de uma carteira de ações orientada por modelos quantitativos, com forte teor matemático, estatístico e computacional.

A carteira de ações do fundo se baseia em modelos de fatores e modelos de tendência Long Only, desenvolvidos para atuar no segmento de pequenas e médias empresas do mercado de ações brasileiro.

As operações sugeridas por esses modelos são avaliadas pela equipe de gestão. A decisão de investimento é tomada quando há convergência entre o quantitativo e o qualitativo.

	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2020													
GEMS	1,1%	-8,9%	-34,6%	13,9%	3,5%	15,1%	6,4%	-3,1%	-6,0%	-2,0%	12,2%	5,9%	-7,9%
SMLL	0,5%	-8,3%	-35,1%	10,2%	5,1%	14,4%	9,5%	-1,2%	-5,4%	-2,3%	16,6%	7,5%	-0,7%
2021													
GEMS	-2,8%	0,3%	9,5%	9,8%									17,2%
SMLL	-3,4%	-1,8%	4,6%	4,4%									3,5%



**CARACTERÍSTICAS DO PORTFÓLIO**

Abr-21

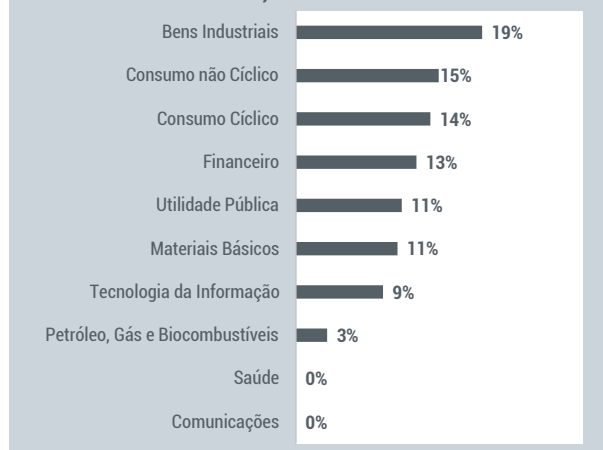
Exposição Líquida	99,4%
Exposição Bruta	99,4%
Exposição Máxima por Empresa	4,2%
Exposição Média por Empresa	1,9%
Número de Empresas	52
Market Cap Médio por Empresa	\$8 Bi

**RISCO-RETORNO**

Desde início\*

Retorno	7,7%
Small Caps B3	2,8%
Volatilidade	40,1%
Vol. Small Caps B3	43,9%
Correlação	0,98
Beta	0,89

**EXPOSIÇÃO POR SETOR**



**Ray**  
 SMALL CAP

**CONHEÇA NOSSOS ROBÔS**

Ray estuda o balanço das companhias para construir uma carteira de ações capaz de bater o **índice de small caps**.

Saiba mais em:

[www.quantamental.com.br](http://www.quantamental.com.br)