

QUANTAMENTAL HEDGE FIC FIM

OBJETIVO

O FUNDO busca proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital por meio do investimento de seus recursos primordialmente no mercado acionário montando posições compradas e vendidas, no Brasil e no exterior, com base em modelos quantitativos

POLÍTICA DE INVESTIMENTO

O Fundo aplica, no mínimo, 95% em cotas do Quantamental HEDGE MASTER FIM, cuja política de investimento busca proporcionar aos seus cotistas ganhos de capital por meio do investimento de seus recursos primordialmente no mercado acionário, no Brasil e no exterior, com base em modelos quantitativos.

PÚBLICO ALVO

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

INFORMAÇÕES DO FUNDO

Categoria Anbima: Multimercado Long and Short – Direcional
Início do Fundo: 30/12/2019
Tributação: Longo Prazo *

PATRIMÔNIO

Hedge: R\$23.392.038,61
Médio/últimos 12 meses: R\$15.655.010,98

MOVIMENTAÇÕES

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

RESGATES

Cotização: D+15 (corridos)
Pagamento: D+2 (2 dia útil após a cotização)

HORÁRIO DE MOVIMENTAÇÃO

Até às 14:30h

TAXAS

Taxa de Administração: 1,50% a.a.
Taxa de Performance: 20% sobre CDI

* IR Retido na fonte, semestralmente, no último dia útil, meses de Maio e Dezembro, aplicando-se 15%. No resgate é aplicada a alíquota complementar, em função do prazo de aplicação conforme escrito abaixo:

- I. 22,5% aplic. prazo de 180 dias
- II. 20% aplic. prazo entre 181 e 360 dias
- III. 17,5% aplic. prazo entre 361 e 720 dias
- IV. 15% aplic. prazo superior a 720 dias

GESTOR

Itaú Unibanco S.A

ADMINISTRADOR

BTG Pactual Serviços Financeiros S.A.
DTVM

AUDITOR

KPMG Auditores Independentes

CUSTODIANTE

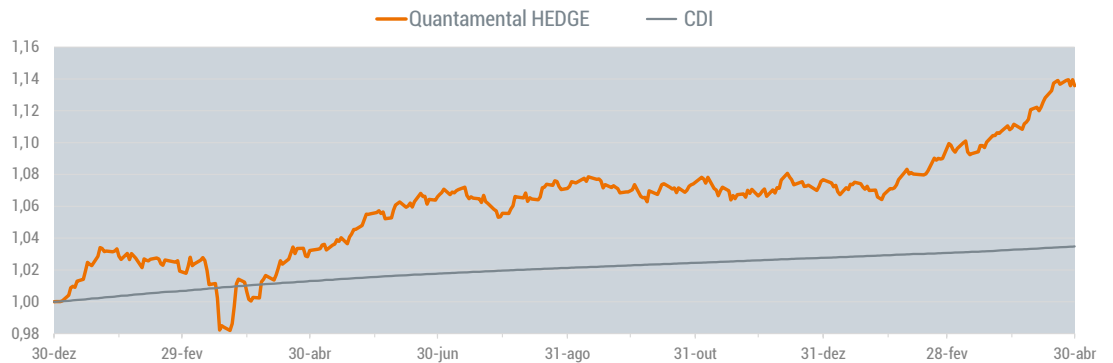
Banco BTG Pactual S.A.

ESTRATÉGIA MARKET NEUTRAL QUANTITATIVA

O fundo tem como objetivo oferecer um rendimento superior ao CDI, atuando no mercado de ações com exposição neutra, volatilidade moderada e carteira altamente diversificada. Para atingir este objetivo, utilizamos modelos quantitativos, com forte teor matemático, estatístico e computacional.

A carteira do fundo se baseia em modelos de fatores, arbitragem estatística e de tendência Long & Short. 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	Feb	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ano
2020	HEDGE	2,7%	-0,7%	-1,3%	2,6%	2,2%	1,0%	-1,0%	1,5%	-0,1%	0,4%	-0,7%	0,9%	7,7%
	%CDI	704%	-	-	909%	935%	470%	-	922%	-	261%	-	577%	277%
2021	HEDGE	-0,9%	2,1%	1,8%	2,4%									5,5%
	%CDI	-	1577%	886%	1151%									793%



CARACTERÍSTICAS DO PORTFÓLIO

Abr-21

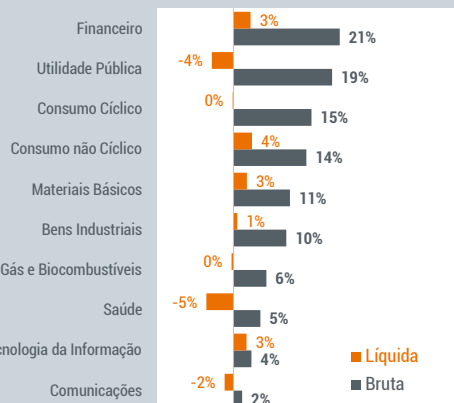
Exposição Líquida	3,0%
Exposição Bruta	143,6%
Maior Exposição por Empresa	3,0%
Exposição Média por Empresa	0,8%
Número de Ações	179
Market Cap Médio por Ação - Brasil	\$54 Bi

RISCO-RETORNO

Desde o início

Retorno	13,6%
CDI	3,5%
%CDI	390%
Volatilidade	5,1%
Sharpe	1,5

EXPOSIÇÃO POR SETOR - BRASIL



ROBÔ DO MÊS

Perspicaz em encontrar oportunidades no mercado operando na **contra-tendência**.

Saiba mais em:
www.quantamental.com.br