

ESTRATÉGIA

O fundo de investimentos Prospera Quant FIF adota uma estratégia de investimento baseada em fatores para a seleção de ações na bolsa brasileira. Esta abordagem identifica e explora fatores específicos que historicamente têm mostrado potencial para gerar retornos acima da média. Entre os principais fatores considerados estão valor, qualidade, momentum, tamanho e volatilidade.

Utilizando modelos quantitativos avançados, analisamos extensos conjuntos de dados financeiros para selecionar ações que exibem características desejáveis de acordo com esses fatores. Nossa metodologia envolve a aplicação de algoritmos estatísticos para construir um portfólio otimizado, maximizando o retorno ajustado ao risco.

RENTABILIDADES DA CARTEIRA

| | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | JUL | AGO | SET | OUT | NOV | DEZ | ANO | INÍCIO |
|--------|--------|---------|---------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|--------|--------|--------|
| 2023 | | | | | | | | | | | | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| - IBOV | | | | | | | | | | | | 0,0% | 0,0% | 0,0% |
| 2024 | -9,36% | 4,38% | -2,16% | -3,64% | 2,21% | -0,9% | -0,43% | 17,27% | -3,01% | 6,65% | 1,05% | -2,76% | 7,23% | 7,23% |
| - IBOV | -4,6% | 3,4% | -1,5% | -1,9% | +5,2% | -2,4% | -3,4% | 10,7% | 0,1% | 8,2% | 4,2% | 1,5% | 17,6% | 17,6% |
| 2025 | 0,16% | -12,33% | 26,06% | 2,49% | 2,01% | -2,45% | -2,50% | 3,62% | 8,85% | 0,85% | 4,46% | 1,68% | 32,96% | 42,57% |
| - IBOV | -4,7% | -9,7% | 20,0% | -1,2% | 0,6% | -3,8% | 1,7% | -2,7% | 5,4% | -1,4% | -1,9% | 0,4% | -1,0% | 22,5% |
| 2026 | 10,62% | -1,65% | -13,69% | | | | | | | | | | -6,10% | 33,87% |
| - IBOV | -1,9% | -5,7% | -13,0% | | | | | | | | | | -22,4% | -5,8% |

FILOSOFIA DE INVESTIMENTOS

O Prospera Quant FIF mantém uma filosofia de investimento "long only", sem realizar operações de day trade ou utilizar alavancagem. Isso significa que o fundo está sempre posicionado em ações de alta qualidade com potencial de valorização no longo prazo, evitando riscos excessivos associados a práticas de trading intensivo.

Ao investir no Prospera Quant FIF, você se beneficia de uma estratégia disciplinada e fundamentada em rigorosa análise quantitativa, com o objetivo de proporcionar retornos consistentes e sustentáveis, alinhados com uma gestão prudente e transparente.

ESTATÍSTICAS

| | |
|-------------------------|------------|
| MESES POSITIVOS | 15 (53,6%) |
| MESES NEGATIVOS | 13 (46,4%) |
| MESES ACIMA DO IBOV | 12 (42,9%) |
| MESES ABAIXO DO IBOV | 16 (57,1%) |
| MAIOR ALTA | 26,1% |
| MAIOR QUEDA | -13,7% |
| VOLATILIDADE ANUALIZADA | 29,6% |
| NÚMERO DE COTISTAS | 7 |

INFORMAÇÕES GERAIS

| | |
|--------------------------------|-------------------------------|
| PÚBLICO ALVO | Investidores em geral |
| CLASSIFICAÇÃO ANBIMA | Ações Livre |
| DATA DE INÍCIO | 27/12/2023 |
| APLICAÇÃO | D+1 |
| RESGATE (COTIZAÇÃO) | D+15 (corridos) |
| RESGATE (LIQUIDAÇÃO) | D+2 (úteis) da cotização |
| APLICAÇÃO MÍNIMA | R\$ 500,00 |
| MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA | R\$ 100,00 |
| TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | 2% a.a. |
| TAXA DE PERFORMANCE | 20% s/ IBOV, com marca d'água |
| GESTOR | Majora Capital |
| ADMINISTRADOR E CUSTODIANTE | Banco Daycoval S.A. |
| TRIBUTAÇÃO | Renda Variável |
| PATRIMÔNIO LÍQUIDO | R\$ 7.344.648,30 |
| PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO (12M) | R\$ 7.036.573,60 |