

# DEMONSTRATIVO DE PREVIDÊNCIA | Outubro de 2022

ACOMPANHAMENTO PERFIL QUANTA PREVCOOP

## PERFIL RENDA FIXA

PATRIMÔNIO  
R\$ 63.733.668

% TÍTULOS PÚBLICOS  
42,17%

% TÍTULOS PRIVADOS  
50,97%

% RENDA VARIÁVEL  
0,00%

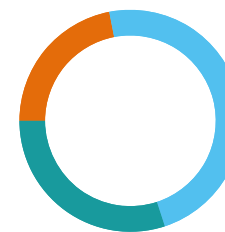
TAXA DE ADM. (A.A)  
0,25%

COMPOSIÇÃO POR  
FUNDOS

COMPOSIÇÃO POR  
INDEXADOR

### HISTÓRICO DE TAXA - PERFIL RENDA FIXA

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	% CDI NO ANO
2019	0,60%	0,60%	0,49%	0,66%	0,67%	0,47%	0,51%	0,49%	0,49%	0,43%	0,16%	0,59%	106,23%
2020	0,59%	0,27%	-1,82%	0,17%	0,29%	0,56%	0,86%	0,68%	0,45%	0,53%	0,54%	0,60%	135,75%
2021	0,68%	0,43%	0,82%	0,57%	0,58%	0,71%	0,77%	0,76%	0,76%	0,69%	0,92%	1,01%	206,15%
2022	0,74%	0,96%	1,29%	1,11%	1,23%	0,99%	0,99%	1,19%	0,99%	0,96%	-	-	109,56%



21,93% QP1  
48,06% QP3  
30,01% QP4

14,88% Pré  
19,91% IPCA  
2,55% Fundos  
11,19% Selic  
4,45% Ibovespa  
47,02% CDI

## PERFIL QUANTA

PATRIMÔNIO  
R\$ 172.345.436

% TÍTULOS PÚBLICOS  
47,64%

% TÍTULOS PRIVADOS  
19,10%

% RENDA VARIÁVEL  
10,22%

TAXA DE ADM. (A.A)  
0,25%

COMPOSIÇÃO POR  
FUNDOS

COMPOSIÇÃO POR  
INDEXADOR

### HISTÓRICO DE TAXA - PERFIL QUANTA

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	% CDI NO ANO
2019	0,81%	0,45%	0,48%	0,75%	0,78%	0,80%	0,51%	0,20%	0,83%	1,16%	0,10%	1,62%	147,70%
2020	0,35%	-0,98%	-5,38%	1,87%	1,81%	2,37%	2,10%	-0,72%	-1,18%	-0,48%	2,78%	2,25%	165,43%
2021	-0,47%	-0,81%	0,80%	0,72%	0,95%	0,35%	-0,57%	-0,23%	-0,64%	-0,95%	0,01%	1,01%	2,91%
2022	0,88%	0,39%	1,55%	-0,63%	0,91%	-0,36%	1,55%	1,66%	0,90%	1,44%	-	-	85,75%



16,23% QP1  
10,13% QP3  
20,42% QP4  
25,68% QP5  
14,81% QP6  
10,73% QP7  
2,00% QP8

10,70% Pré  
17,99% IPCA  
18,44% Fundos  
21,74% Selic  
13,03% Ibovespa  
18,10% CDI

## PERFIL RENDA VARIÁVEL

PATRIMÔNIO  
R\$ 32.924.672

% TÍTULOS PÚBLICOS  
28,73%

% TÍTULOS PRIVADOS  
3,54%

% RENDA VARIÁVEL  
45,48%

TAXA DE ADM. (A.A)  
0,25%

COMPOSIÇÃO POR  
FUNDOS

COMPOSIÇÃO POR  
INDEXADOR

### HISTÓRICO DE TAXA - PERFIL RENDA VARIÁVEL

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	% CDI NO ANO
2019	2,51%	0,51%	-0,36%	0,67%	0,88%	1,93%	0,80%	0,00%	1,12%	2,31%	0,45%	2,93%	244,14%
2020	0,22%	-3,28%	-15,41%	4,83%	3,88%	4,86%	4,38%	-1,53%	-2,70%	-0,86%	6,42%	4,03%	100,19%
2021	-1,07%	-1,86%	1,74%	1,24%	2,66%	0,79%	-1,85%	-1,03%	-3,13%	-4,35%	-1,50%	0,93%	-168,29%
2022	2,48%	0,05%	3,02%	-4,65%	0,81%	-4,15%	3,12%	3,21%	0,80%	3,11%	-	-	76,64%



0,54% QP1  
0,47% QP3  
5,36% QP4  
24,93% QP5  
14,28% QP6  
49,37% QP7  
5,04% QP8

7,77% Pré  
4,00% IPCA  
19,94% Fundos  
18,57% Selic  
46,30% Ibovespa  
3,42% CDI

1 - Abertura do Perfil Renda Fixa em Junho/2018.

2 - Abertura do Perfil Renda Variável em Julho/2018.

# DEMONSTRATIVO DE PREVIDÊNCIA | Outubro de 2022

ACOMPANHAMENTO FUNDOS QUANTA PREVCOOP

## FUNDO SOMMA QP1

PATRIMÔNIO

**R\$ 893.468.336,29**

RENT. MÊS %CDI	<b>58,16%</b>
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	<b>104,63%</b>
% TÍTULOS PÚBLICOS	<b>100,00%</b>
% TÍTULOS PRIVADOS	<b>0,00%</b>

## FUNDO QUANTITAS QP3

PATRIMÔNIO

**R\$ 1.658.484.827,05**

RENT. MÊS %CDI	<b>112,30%</b>
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	<b>117,51%</b>
% TÍTULOS PÚBLICOS	<b>32,50%</b>
% TÍTULOS PRIVADOS	<b>67,50%</b>

## FUNDO CAPITÂNIA QP4

PATRIMÔNIO

**R\$ 1.231.100.152,75**

RENT. MÊS %CDI	<b>104,99%</b>
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	<b>122,74%</b>
% TÍTULOS PÚBLICOS	<b>15,30%</b>
% TÍTULOS PRIVADOS	<b>84,70%</b>

## FUNDO CLARITAS QP5

PATRIMÔNIO

**R\$ 428.280.410,86**

RENT. MÊS %CDI	<b>85,61%</b>
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	<b>111,48%</b>
% TÍTULOS PÚBLICOS	<b>99,77%</b>
% TÍTULOS PRIVADOS	<b>0,23%</b>

## FUNDO BTG QP6

PATRIMÔNIO

**R\$ 244.578.769,50**

RENT. MÊS %CDI	<b>165,87%</b>
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	<b>123,08%</b>
% TÍTULOS PÚBLICOS	<b>0,00%</b>
% TÍTULOS PRIVADOS	<b>100,00%</b>

## FUNDO SOMMA QP7

PATRIMÔNIO

**R\$ 382.147.342,21**

RENT. MÊS %CDI	<b>608,72%</b>
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	<b>40,32%</b>
% TÍTULOS PÚBLICOS	<b>1,61%</b>
% TÍTULOS PRIVADOS	<b>98,39%</b>

## FUNDO FRANKLIN QP8

PATRIMÔNIO

**R\$ 50.092.182,42**

RENT. MÊS %CDI	<b>-405,32%</b>
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	<b>-</b>
% TÍTULOS PÚBLICOS	<b>21,10%</b>
% TÍTULOS PRIVADOS	<b>78,90%</b>

### Cenários de Mercado

No Reino Unido, após a renúncia de Liz Truss, Rish Sunak assumiu como novo primeiro-ministro. Com a atividade mais fraca e a inflação chegando a 10,1% em setembro, Sunak deve anunciar um plano fiscal para lidar com a situação desafiadora do Reino Unido. Na Zona do Euro, o Banco Central Europeu (BCE) elevou os juros em 0,75%, atingindo o patamar de 2% a.a. Na China, o presidente Xi Jinping foi reconduzido para um terceiro mandato, com consenso de que ele aumentou seu poder político. A sinalização é a de que ele poderá perseguir seus planos de manter a política de Covid-zero e aumentar a intervenção estatal para alavancar o crescimento econômico. No Brasil, o IPCA do mês apresentou alta de 0,59%, acima das expectativas de mercado e retomando o movimento de elevação após três meses de deflação. Entre os grupos de despesas, o maior impacto veio de alimentação e bebidas, com alta de 0,72% e 0,16 ponto percentual no IPCA geral. No cenário político houve a definição das eleições federais, com a vitória em segundo turno de Lula, mas com um Congresso de maioria de centro-direita, indicando uma menor governabilidade para o presidente eleito. Para frente, espera-se a definição das políticas econômicas que serão implementadas, em especial a regra fiscal adotada que substituirá o teto de gastos.

### Parecer do Gestor - Renda Fixa

O perfil apresentou resultado positivo de 0,96% no mês, marginalmente abaixo do CDI. Os gestores de crédito tiveram um mês menos pujante que os anteriores, onde a principal contribuição positiva foi oriunda do carregamento das taxas dos papéis de crédito privado. Quanto ao segmento de investimento imobiliário, a contribuição foi neutra dado que o IFIX - principal índice de referência - encerrou o mês próximo da estabilidade. Por fim, mesmo com a reversão do movimento deflacionário apresentado nos últimos meses, a parcela de títulos públicos atrelados à inflação (NTN-B) ainda apresentaram rentabilidade abaixo do CDI.

### Parecer do Gestor - Quanta

O perfil apresentou resultado positivo de 1,44% no mês, superando a meta de retorno mensal esperada para o perfil. No segmento de multimercados, o destaque positivo foi oriundo dos fundos estruturados que se beneficiaram das posições táticas em juros nas principais economias e das posições táticas em bolsa que local. Na renda variável local, os gestores entregaram resultados acima do Ibovespa, sendo a principal contribuição para a performance do perfil em outubro. No campo negativo, a única contribuição foi o segmento de investimento no exterior que, além do movimento de queda do dólar frente ao real, teve impactos negativos devido à performance da carteira abaixo dos principais índices globais. Por fim, na renda fixa, a performance foi em linha com CDI.

### Parecer do Gestor - Renda Variável

O perfil apresentou resultado positivo de 3,11% no mês, superando a meta de retorno mensal esperada para o perfil. Na renda variável local, os gestores entregaram resultados acima do Ibovespa, se beneficiando da alta de papéis de empresas relacionadas aos setores mais cíclicos da economia e, portanto, sendo a principal contribuição para a performance do perfil em outubro. No segmento de multimercados, o destaque positivo foi oriundo dos fundos estruturados que se beneficiaram das posições táticas em juros nas principais economias e das posições táticas em bolsa que local. No campo negativo, a única contribuição foi o segmento de investimento no exterior que, além do movimento de queda do dólar frente ao real, teve impactos negativos devido à performance da carteira abaixo dos principais índices globais. Por fim, na renda fixa - menor alocação do perfil - a performance foi em linha com CDI.