

# DEMONSTRATIVO DE PREVIDÊNCIA | Novembro de 2022

ACOMPANHAMENTO PERFIL QUANTA PREVCOOP

## PERFIL RENDA FIXA

PATRIMÔNIO  
R\$ 67.506.619

% TÍTULOS PÚBLICOS  
44,31%

% TÍTULOS PRIVADOS  
47,63%

% 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%	0,89%	-	107,35%



21,24% QP1  
40,25% QP3  
38,51% QP4

16,42% Pré  
21,91% IPCA  
2,49% Fundos  
10,54% Selic  
5,69% Ibovespa  
42,95% CDI

## PERFIL QUANTA

PATRIMÔNIO  
R\$ 173.969.193

% TÍTULOS PÚBLICOS  
47,39%

% TÍTULOS PRIVADOS  
20,99%

% RENDA VARIÁVEL  
10,35%

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%	-0,18%	-	75,38%



9,88% QP1  
14,94% QP3  
20,59% QP4  
26,97% QP5  
15,19% QP6  
10,35% QP7  
2,08% QP8

12,35% Pré  
13,75% IPCA  
18,22% Fundos  
23,77% Selic  
12,90% Ibovespa  
18,88% CDI  
0,13% Cambial

## PERFIL RENDA VARIÁVEL

PATRIMÔNIO  
R\$ 31.914.900

% TÍTULOS PÚBLICOS  
30,45%

% TÍTULOS PRIVADOS  
3,23%

% RENDA VARIÁVEL  
44,01%

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%	-2,84%	-	41,45%



3,17% QP1  
0,52% QP3  
5,47% QP4  
23,08% QP5  
15,89% QP6  
46,79% QP7  
5,09% QP8

7,94% Pré  
6,10% IPCA  
21,09% Fundos  
17,20% Selic  
44,76% Ibovespa  
2,81% CDI  
0,12% Cambial

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

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

# DEMONSTRATIVO DE PREVIDÊNCIA | Novembro de 2022

ACOMPANHAMENTO FUNDOS QUANTA PREVCOOP

## FUNDO SOMMA QP1

PATRIMÔNIO

R\$ 845.173.354,10

RENT. MÊS %CDI	103,16%
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	97,81%
% TÍTULOS PÚBLICOS	100,00%
% TÍTULOS PRIVADOS	0,00%

## FUNDO QUANTITAS QP3

PATRIMÔNIO

R\$ 1.508.749.250,52

RENT. MÊS %CDI	106,61%
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	116,42%
% TÍTULOS PÚBLICOS	31,31%
% TÍTULOS PRIVADOS	68,69%

## FUNDO CAPITÂNIA QP4

PATRIMÔNIO

R\$ 1.546.995.007,45

RENT. MÊS %CDI	57,71%
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	115,03%
% TÍTULOS PÚBLICOS	27,17%
% TÍTULOS PRIVADOS	72,83%

## FUNDO CLARITAS QP5

PATRIMÔNIO

R\$ 439.095.847,72

RENT. MÊS %CDI	51,24%
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	106,60%
% TÍTULOS PÚBLICOS	98,57%
% TÍTULOS PRIVADOS	1,43%

## FUNDO BTG QP6

PATRIMÔNIO

R\$ 258.257.957,29

RENT. MÊS %CDI	-48,39%
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	109,24%
% TÍTULOS PÚBLICOS	0,00%
% TÍTULOS PRIVADOS	100,00%

## FUNDO SOMMA QP7

PATRIMÔNIO

R\$ 360.590.046,56

RENT. MÊS %CDI	-614,79%
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	12,36%
% TÍTULOS PÚBLICOS	6,20%
% TÍTULOS PRIVADOS	93,80%

## FUNDO FRANKLIN QP8

PATRIMÔNIO

R\$ 51.092.746,92

RENT. MÊS %CDI	229,89%
RENT. ACUM. 12 MESES %CDI	-
% TÍTULOS PÚBLICOS	6,85%
% TÍTULOS PRIVADOS	93,15%

### Cenários de Mercado

Na Europa, a prévia do índice de preços ao consumidor apresentou queda de 0,1% em novembro, enquanto nos EUA foi observada alta de 0,4% em outubro, mas com resultados abaixo das expectativas (0,6%). Os resultados indicam uma moderação no ritmo de aperto monetário nas duas regiões, mas corroboram as expectativas de que os juros devem permanecer elevados por período prolongado para garantir o processo de desinflação. Na China, o governo anunciou um pacote de medidas que visem maior flexibilização a política de COVID zero, com expectativas de retomada do crescimento econômico nessa região. No Brasil, o mês foi marcado pelas incertezas envolvendo o cenário fiscal. A PEC da Transição, que prevê um montante de gastos fora do teto pelos próximos quatro anos, provocou uma elevação no prêmio de risco do país e, conseqüentemente, um aumento nas taxas de juros. Apesar disso, espera-se que o projeto entregue pela equipe de transição ao Senado sofra diversas modificações, com o texto final apresentando um impacto fiscal menor. No entanto, o cenário ainda é incerto, dado que o mercado ainda espera a indicação do time econômico e das políticas adotadas pelo novo governo.

### Parecer do Gestor - Renda Fixa

O perfil apresentou resultado positivo de 0,89% no mês, abaixo do CDI (87% CDI). Esse cenário de instabilidade interna, especialmente no que diz respeito ao risco fiscal do país, tem movimentado muito os mercados. Temos observado volatilidade e retração nos principais índices de mercado, inclusive renda fixa e fundos imobiliários. Quanto ao segmento de investimento imobiliário, principal destaque negativo do mês, o IFIX encerrou o mês com queda de -4,15%, maior perda mensal desde março de 2020. Na estratégia de juros ativos, o resultado foi marginalmente negativo com a posição vendida em inflação implícita como principal vetor. No campo positivo, a parcela de crédito privado teve performance marginalmente acima do CDI, com o carregamento dos papéis como principal componente de retorno. Por fim, apesar da inflação de 0,41% em novembro ter vindo abaixo das expectativas, a parcela de títulos públicos atrelados ao IPCA (NTN-B) apresentou rentabilidade marginalmente acima do CDI.

### Parecer do Gestor - Quanta

O perfil apresentou queda de -0,18% no mês. Esse cenário de instabilidade interna, especialmente no que diz respeito ao risco fiscal do país, tem movimentado muito os mercados. Temos observado volatilidade e retração nos principais índices de mercado, inclusive renda fixa e fundos imobiliários. No segmento imobiliário, o IFIX encerrou o mês com queda de -4,15%, maior perda mensal desde março de 2020. Na estratégia de juros ativos, o resultado foi marginalmente negativo com a posição vendida em inflação implícita como principal vetor. No segmento de multimercados, o destaque negativo foi oriundo dos fundos estruturados que sofreram perdas com as posições tomadas em juros globais e na bolsa brasileira. Na renda variável local, os gestores tiveram resultado abaixo do Ibovespa, causado pela queda das empresas cíclicas que sofreram perdas com a forte abertura na curva de juros futuros. No campo positivo, o segmento de investimento no exterior foi a principal contribuição positiva com alta de 2,35%, impulsionado pela retomada positiva nos mercados globais e pela alta do dólar frente ao real. Por fim, a parcela de renda fixa teve performance em linha com o CDI nos ativos de crédito privado e títulos públicos.

### Parecer do Gestor - Renda Variável

O perfil apresentou queda de -2,84% no mês. Esse cenário de instabilidade interna, especialmente no que diz respeito ao risco fiscal do país, tem movimentado muito os mercados. Temos observado volatilidade e retração nos principais índices de mercado, inclusive renda fixa e fundos imobiliários. Na renda variável local, os gestores foram fortemente impactados pelo desempenho negativo dos papéis de empresas atreladas à economia interna e encerraram o mês com performance abaixo do Ibovespa. Por serem investimentos com um prazo de maturação mais longo, acabaram fortemente impactadas pela alta volatilidade dos juros futuros. No segmento de multimercados, o destaque negativo foi oriundo dos fundos estruturados que sofreram perdas com as posições tomadas em juros globais e na bolsa brasileira. No segmento imobiliário, o IFIX encerrou o mês com queda de -4,15%, maior perda mensal desde março de 2020. Na estratégia de juros ativos, o resultado foi marginalmente negativo com a posição vendida em inflação implícita como principal vetor. No campo positivo, o segmento de investimento no exterior foi a principal contribuição positiva com alta de 2,35%, impulsionado pela retomada positiva nos mercados globais e pela alta do dólar frente ao real.