

**pps** *portfolio  
performance*

*Avaliação de Performance: RECKITT PREV*

*Fevereiro/2023*

### RENDA FIXA

- **CARTEIRA INFLAÇÃO (WESTERN):** Esta carteira é composta, preponderantemente, por títulos públicos que serão mantidos até o vencimento, sendo, portanto, apreçados pela curva do papel. Dessa forma, limitamo-nos a comentar que o rendimento dos últimos doze meses, de 12,54%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 10,74%, que corresponde ao INPC acrescido de 5,00% ao ano.

- **CARTEIRA RENDA FIXA (WESTERN):** Nos últimos doze meses, o comportamento desta carteira seguiu bastante ruim e afetado pelo impacto, contabilizado no início deste ano, oriundo da exposição em debêntures das Lojas Americanas. O desempenho mensal desagradou, graças ao deságio aplicado nos ativos emitidos pela Light, cujo breve histórico, extraído de um relatório elaborado pelo próprio gestor, encontra-se abaixo:

*“ No dia 31 de janeiro, respondendo a uma requisição de esclarecimento da CVM em relação a notícia divulgada pela mídia, a empresa confirmou ao mercado, via divulgação de Comunicado ao Mercado, a contratação da Laplace Finanças para obter assessoria na análise de alternativas financeiras com o objetivo de apresentar melhorias em sua estrutura de capital, sem fornecer ao mercado maiores detalhes sobre seu plano e o escopo do trabalho.”*

*“ A confirmação da contratação de assessoria financeira especializada em reestruturação financeira, associada à relutância da empresa em esclarecer de maneira objetiva o escopo de trabalho desse serviço, acentuou a percepção entre os investidores de que uma eventual renegociação estaria entre as possibilidades consideradas pelo sênior management da empresa. Diante da incerteza deixada sobre o assunto, os papéis dessa emissora no mercado secundário passaram a precificar um desconto relevante em relação ao seu valor de face.”*

Como era de se esperar, o histórico construído em períodos mais longos também foi prejudicado. Diante do exposto, é de suma importância acompanhar as providências que estão sendo desenvolvidas pela Western, a fim de tentar reverter essa delicada situação.

### RENDA VARIÁVEL

- **CARTEIRA RENDA VARIÁVEL (WESTERN):** O desempenho mensal fornecido pela Western no segmento de renda variável nos pareceu razoável. O retorno acumulado, pouco superior ao “benchmark” proposto, foi o 14º colocado entre 33 possibilidades. O risco total e o beta figuraram abaixo da mediana da amostra; contrapondo-se ao risco diversificável. Os índices de Jensen e de Modigliani, medidas de retorno ajustado por risco, poderiam ter sido melhores. Em fevereiro, há indícios de insucesso na seleção dos ativos e de sucesso em “timing”. O histórico dos últimos doze meses, bem como o de períodos mais longos, deixou a desejar. Como já é sabido, a Reckitt Prev tem avançado nas discussões quanto a substituição da Western neste segmento de aplicação, suportada pelo estudo de seleção de gestores elaborado pela PPS, entregue no final de jun/22.

## INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

- **CARTEIRA ESTRUTURADOS (WESTERN):** Os recursos alocados nesta carteira encontram-se investidos em dois fundos. O Western Asset Long & Short FIM, cujo objetivo é buscar, a longo prazo, retornos superiores à variação do CDI, através de investimentos em ações e derivativos via posições compradas e vendidas, sendo que para a seleção dos ativos, o gestor não utiliza como referência a carteira teórica de nenhum índice existente no mercado de ações, procurando minimizar a exposição direcional ao mercado acionário; e o Western Asset Dinâmico FIC FIM, cujo objetivo é buscar a médio e longo prazos retornos superiores à variação do CDI, através de estratégias direcionais, tanto ativas quanto passivas, nos mercados de juros pré-fixados, inflação e câmbio. Os títulos privados, operações não direcionais e ativos financeiros negociados no exterior também são fontes potenciais de valor. Nos últimos doze meses, a performance percebida pelos investimentos estruturados da Entidade, quando comparada com o índice de referência (“benchmark”) estabelecido em sua Política de Investimentos, não atendeu às expectativas. O desempenho mensal poderia ter sido melhor. Como já é sabido, a Reckitt Prev tem avançado nas discussões quanto a substituição da Western neste segmento de aplicação, suportada pelo estudo de seleção de gestores elaborado pela PPS, entregue no final de jun/22.

## INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

- **CARTEIRA EXTERIOR (WESTERN):** Os recursos alocados nesta carteira encontram-se investidos em dois fundos. O Western Asset Macro Opportunities, sem exposição à variação cambial, cujo objetivo é maximizar o retorno total em relação a uma meta de volatilidade entre 8% e 10% ao ano, utilizando-se de estratégias no mercado de renda fixa global; e o Western Asset FIA BDR Nível I, com exposição à variação cambial, cujo objetivo é buscar um retorno absoluto, procurando entregar 4% ao ano em adição à performance do índice S&P 500 (em R\$), utilizando-se de estratégias ativas em relação a composição desse índice, através de uma carteira diversificada de recibos de ações de empresas americanas, negociados no Brasil. Nos últimos doze meses, a performance percebida pelos investimentos no exterior da Entidade ofereceu rendimento negativo e extremamente inferior à variação do índice de referência (“benchmark”) estabelecido em sua Política de Investimentos. O desempenho mensal também desagradou. Diante do exposto, nos parece prudente manter o gestor “em observação”, lembrando que o histórico construído em períodos mais longos, dada a forte queda contabilizada no ano passado, permaneceu ruim.

## CONSOLIDADO

- **CARTEIRA CONSOLIDADA - (WESTERN) - Gestão Ativa:** O desempenho mensal desta carteira consolidada não foi bom, com destaque negativo para a subtração de valor oriunda da exposição em renda variável e no exterior. Além disso, o histórico dos últimos doze meses seguiu ruim. Diante do exposto, sugere-se que a Reckitt Prev acompanhe de perto as providências que o gestor irá desenvolver para tentar reverter este quadro. Como já é sabido, a Entidade tem avançado em algumas discussões com o intuito de promover mudanças, conforme indicado anteriormente, sem renunciar a diversificação, um aspecto importantíssimo na construção de um portfólio eficiente.

### DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA ENTIDADE – FEVEREIRO DE 2023

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	28.429.341,49	16,81%

## CONSIDERAÇÕES – AVALIAÇÃO DE PERFORMANCE (FEVEREIRO DE 2023)

### DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA ENTIDADE – FEVEREIRO DE 2023

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Ativa)	107.490.850,75	63,56%
Renda Variável	7.813.460,80	4,62%
Estruturado	15.836.958,72	9,36%
Exterior	9.560.813,75	5,65%
<b>Total</b>	<b>169.131.425,51</b>	<b>100,00%</b>

Fonte: PPS

### CONSIDERAÇÕES FINAIS:

Para participar dos "clusters" os fundos devem ter:

- Histórico de cotas condizente com o período de análise; e

- Patrimônio superior a R\$ 10 MM na Renda Variável.

Os períodos de análise foram definidos em conjunto com o cliente.



*Agrupamento: -.-  
RENTA FIXA (Títulos na Curva)*

*Fevereiro/2023*

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RF INFL. (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,07%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (INFL)

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 5,12643  
 PATRIMÔNIO: 28.429.341,49

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (INFL)

### ANÁLISE DE ESTILO

CDI	96,73%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	2,74%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,28%	DÓLAR PTAX	0,25%

ESTILO: 2,12%

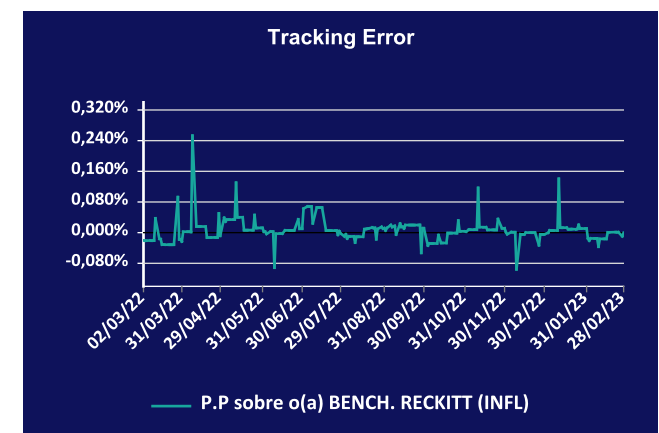
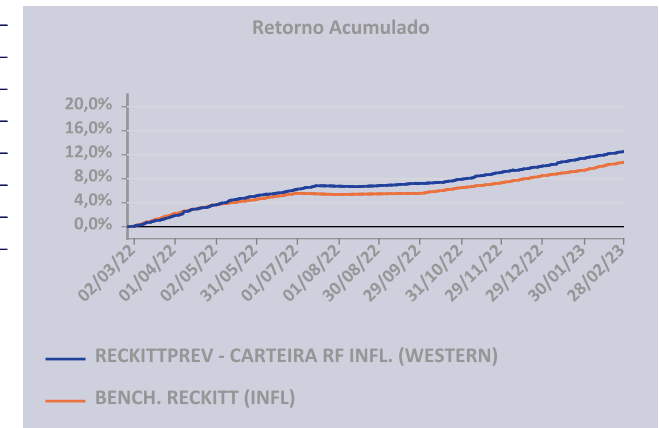
SELEÇÃO: 97,88%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0016%	--
RETORNO ACUMULADO	12,5400%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,7441%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	1,7958%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0435	--
SORTINO	-0,0680	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	20,6121	--
DOWNSIDE RISK	0,0242%	--
RISCO ATIVO	0,0311%	--
RISCO TOTAL	0,0364%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,5791%	--

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	7
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	5
MAIOR RETORNO MENSAL	1,7663%(04/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	0,0760%(08/2022)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (INFL), vide composição na capa.

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,98%	2,20%	12,54%	31,17%	44,68%	0,33% (08/04/2022)	-0,05% (28/09/2022)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,18%	2,06%	10,74%	28,84%	43,69%	0,10% (02/03/2022)	-0,01% (06/07/2022)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (08/03/2022)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	0,96%	2,12%	13,15%	20,18%	22,59%	0,06% (04/01/2023)	0,01% (20/04/2022)
IMA-B	1,28%	1,28%	7,94%	8,94%	12,38%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,84%	1,37%	5,60%	16,73%	22,79%	0,07% (02/03/2022)	-0,03% (01/07/2022)
INPC	0,77%	1,23%	5,47%	16,86%	24,12%	0,08% (02/03/2022)	-0,03% (13/07/2022)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RF INFL. (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,07%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (INFL)

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 5,12643  
 PATRIMÔNIO: 28.429.341,49

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (INFL)

### ANÁLISE DE ESTILO

CDI	96,02%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	3,97%	IMA B 5+	0,01%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 7,48%

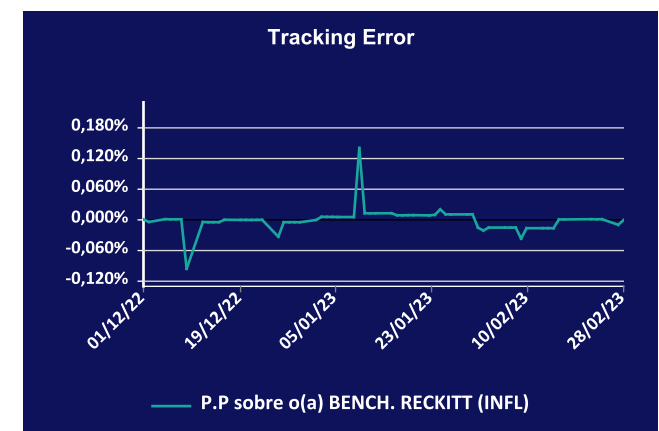
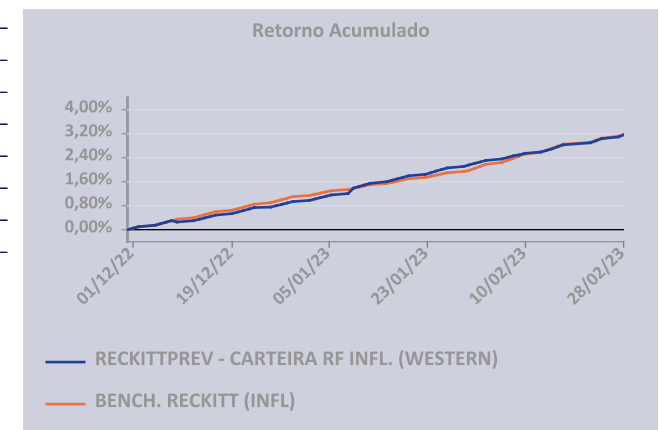
SELEÇÃO: 92,52%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0006%	--
RETORNO ACUMULADO	3,1572%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,1829%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,0256%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0287	--
SORTINO	-0,0463	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	21,7198	--
DOWNSIDE RISK	0,0137%	--
RISCO ATIVO	0,0244%	--
RISCO TOTAL	0,0221%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,3510%	--

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,2125%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9362%(12/2022)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (INFL), vide composição na capa.

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,98%	2,20%	12,54%	31,17%	44,68%	0,18% (10/01/2023)	-0,05% (09/12/2022)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,18%	2,06%	10,74%	28,84%	43,69%	0,07% (01/02/2023)	0,04% (02/01/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,49% (20/12/2022)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	0,96%	2,12%	13,15%	20,18%	22,59%	0,06% (04/01/2023)	0,05% (19/12/2022)
IMA-B	1,28%	1,28%	7,94%	8,94%	12,38%	0,78% (15/02/2023)	-0,67% (02/01/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,31% (12/12/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,37% (15/02/2023)	-0,26% (02/01/2023)
IPCA	0,84%	1,37%	5,60%	16,73%	22,79%	0,05% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
INPC	0,77%	1,23%	5,47%	16,86%	24,12%	0,04% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 Cód. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RF INFL. (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,07%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (INFL)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 5,12643  
 PATRIMÔNIO: 28.429.341,49

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (INFL)

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,81%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,19%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 0,07%

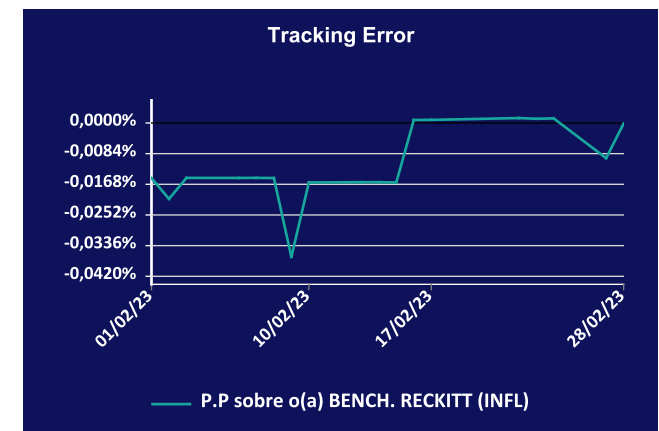
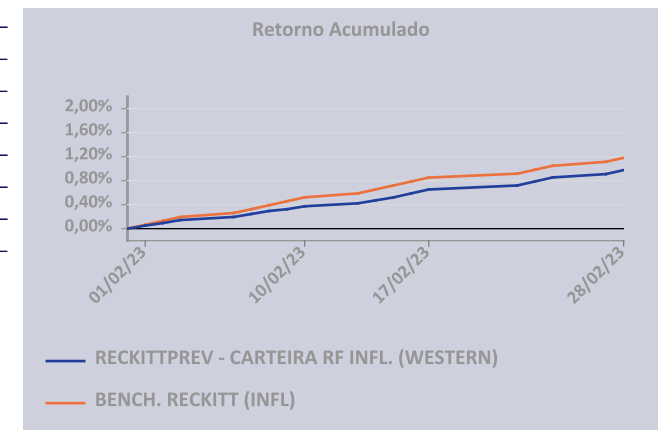
SELEÇÃO: 99,93%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0031%	--
RETORNO ACUMULADO	0,9762%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,1805%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,2043%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,3112	--
SORTINO	0,5787	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,7886	--
DOWNSIDE RISK	0,0055%	--
RISCO ATIVO	0,0102%	--
RISCO TOTAL	0,0102%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,1631%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,9762%(02/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,9762%(02/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (INFL), vide composição na capa.

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,98%	2,20%	12,54%	31,17%	44,68%	0,07% (22/02/2023)	0,03% (09/02/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	1,18%	2,06%	10,74%	28,84%	43,69%	0,07% (01/02/2023)	0,07% (01/02/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	0,96%	2,12%	13,15%	20,18%	22,59%	0,06% (28/02/2023)	0,05% (06/02/2023)
IMA-B	1,28%	1,28%	7,94%	8,94%	12,38%	0,78% (15/02/2023)	-0,48% (03/02/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,37% (15/02/2023)	-0,21% (03/02/2023)
IPCA	0,84%	1,37%	5,60%	16,73%	22,79%	0,05% (01/02/2023)	0,05% (01/02/2023)
INPC	0,77%	1,23%	5,47%	16,86%	24,12%	0,04% (01/02/2023)	0,04% (01/02/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)





*Agrupamento: Renda Fixa*  
*ÍNDICES (PPS)*

*Fevereiro/2023*

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: --  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH.RECKITT (RF)

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,87876  
 PATRIMÔNIO: 107.490.850,75

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: RENDA FIXA - ÍNDICES  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH.RECKITT (RF)

### ANÁLISE DE ESTILO

CDI	76,52%	IRF-M	11,67%
IMA B 5	10,38%	IMA B 5+	1,06%
IMA-C	0,02%	DÓLAR PTAX	0,35%

ESTILO: 16,93%

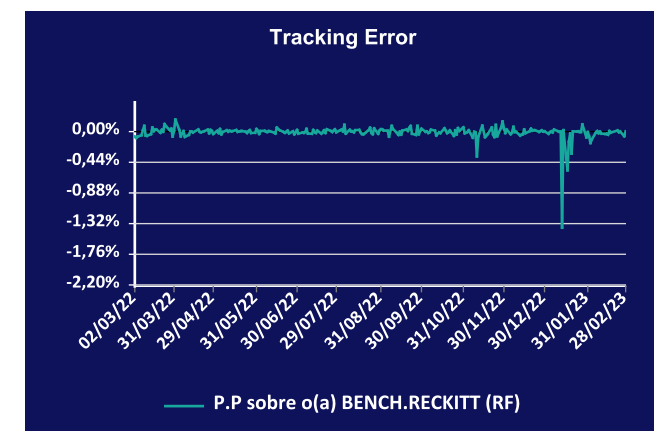
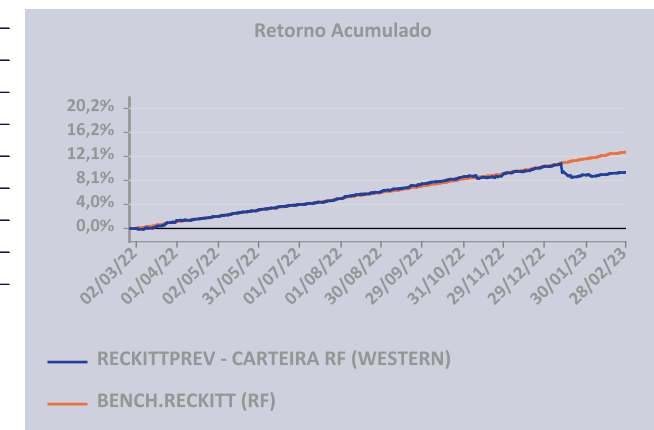
SELEÇÃO: 83,07%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0126%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	9,4677%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	12,8686%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,4009%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,8115	9° de 15
SHARPE	-0,1134	13° de 15
SORTINO	-0,1197	12° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	112,2079	--
DOWNSIDE RISK	0,1054%	3° de 15
RISCO ATIVO	0,1063%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,1110%	5° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7634%	5° de 15

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	11
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	5
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	7
MAIOR RETORNO MENSAL	1,2148%(08/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,2682%(01/2023)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH.RECKITT (RF), vide composição na capa.

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,39%	-0,88%	9,47%	14,06%	16,89%	0,25% (01/04/2022)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	0,97%	2,13%	12,87%	20,76%	24,66%	0,10% (04/08/2022)	-0,01% (10/11/2022)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (08/03/2022)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	0,96%	2,12%	13,15%	20,18%	22,59%	0,06% (04/01/2023)	0,01% (20/04/2022)
IMA-B	1,28%	1,28%	7,94%	8,94%	12,38%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,84%	1,37%	5,60%	16,73%	22,79%	0,07% (02/03/2022)	-0,03% (01/07/2022)
INPC	0,77%	1,23%	5,47%	16,86%	24,12%	0,08% (02/03/2022)	-0,03% (08/07/2022)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 Cód. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: --  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH.RECKITT (RF)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,87876  
 PATRIMÔNIO: 107.490.850,75

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: RENDA FIXA - ÍNDICES  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH.RECKITT (RF)

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	88,94%	IRF-M	2,68%
IMA B 5	7,50%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,88%

ESTILO: 0,71%

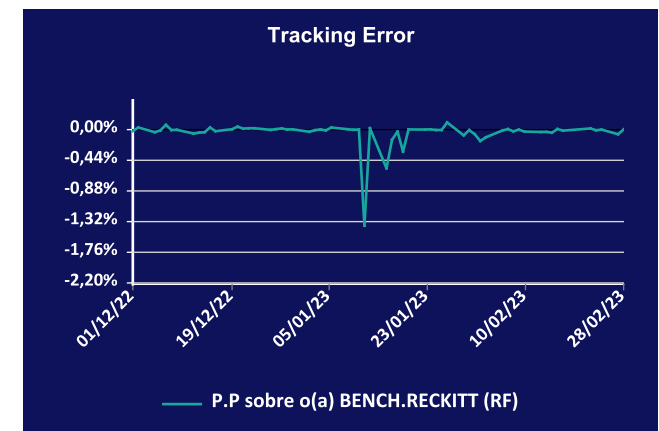
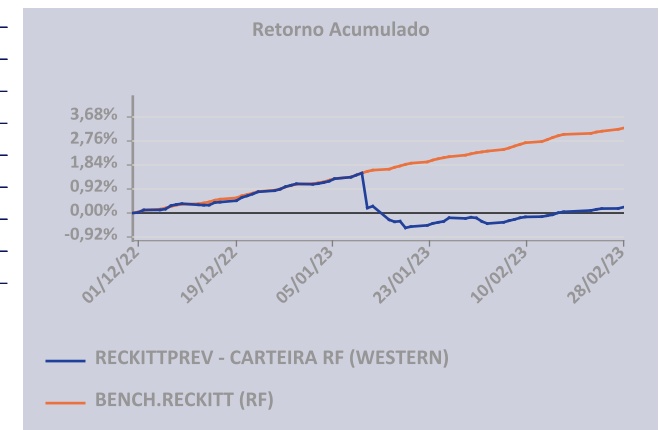
SELEÇÃO: 99,29%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0469%	13° de 15
RETORNO ACUMULADO	0,2253%	13° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,2578%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,0325%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-3,9332	9° de 15
SHARPE	-0,2422	12° de 15
SORTINO	-0,2388	12° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	37,0196	--
DOWNSIDE RISK	0,1966%	2° de 15
RISCO ATIVO	0,1933%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,1938%	2° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	3,0776%	2° de 15

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	1,1182%(12/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,2682%(01/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH.RECKITT (RF), vide composição na capa.

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,39%	-0,88%	9,47%	14,06%	16,89%	0,14% (27/01/2023)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	0,97%	2,13%	12,87%	20,76%	24,66%	0,08% (15/02/2023)	0,02% (12/12/2022)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,49% (20/12/2022)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	0,96%	2,12%	13,15%	20,18%	22,59%	0,06% (04/01/2023)	0,05% (19/12/2022)
IMA-B	1,28%	1,28%	7,94%	8,94%	12,38%	0,78% (15/02/2023)	-0,67% (02/01/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,31% (12/12/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,37% (15/02/2023)	-0,26% (02/01/2023)
IPCA	0,84%	1,37%	5,60%	16,73%	22,79%	0,05% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
INPC	0,77%	1,23%	5,47%	16,86%	24,12%	0,04% (01/02/2023)	0,02% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 Cód. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: --  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH.RECKITT (RF)

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,87876  
 PATRIMÔNIO: 107.490.850,75

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: RENDA FIXA - ÍNDICES  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH.RECKITT (RF)

### ANÁLISE DE ESTILO

CDI	81,27%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	18,67%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,06%

ESTILO: 31,00%

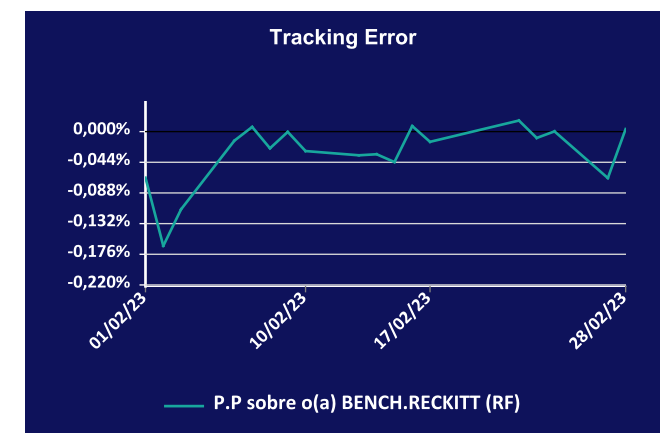
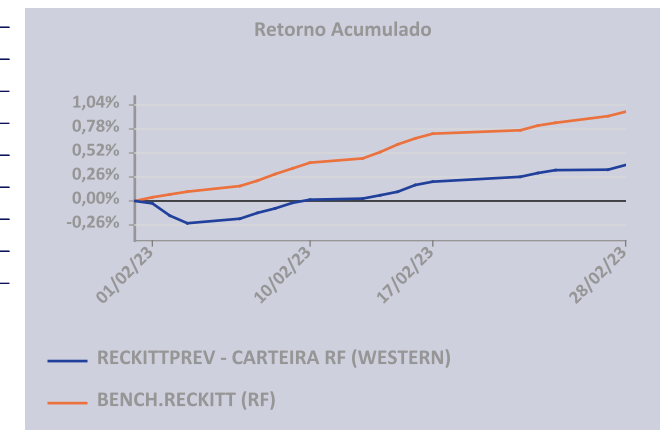
SELEÇÃO: 69,00%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0291%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	0,3901%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9671%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5769%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-10,9509	10° de 15
SHARPE	-0,5495	15° de 15
SORTINO	-0,4952	15° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,4298	--
DOWNSIDE RISK	0,0588%	6° de 15
RISCO ATIVO	0,0461%	2° de 15
RISCO TOTAL	0,0530%	12° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,8416%	12° de 15

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	0
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,3902%(02/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,3902%(02/2023)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH.RECKITT (RF), vide composição na capa.

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,39%	-0,88%	9,47%	14,06%	16,89%	0,07% (16/02/2023)	-0,13% (02/02/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	0,97%	2,13%	12,87%	20,76%	24,66%	0,08% (15/02/2023)	0,03% (03/02/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA-S	0,96%	2,12%	13,15%	20,18%	22,59%	0,06% (28/02/2023)	0,05% (06/02/2023)
IMA-B	1,28%	1,28%	7,94%	8,94%	12,38%	0,78% (15/02/2023)	-0,48% (03/02/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,37% (15/02/2023)	-0,21% (03/02/2023)
IPCA	0,84%	1,37%	5,60%	16,73%	22,79%	0,05% (01/02/2023)	0,05% (01/02/2023)
INPC	0,77%	1,23%	5,47%	16,86%	24,12%	0,04% (01/02/2023)	0,04% (01/02/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/03/2022 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA, MULTIMERCADO  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO INFORMATION RATIO ANUAL  
 PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	INFORMATION RATIO	RETORNO	SHARPE	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE M - BAHIA	0,0904	12,6026%	-0,0160	1,3895%	0,77%	92.116.081,34	251
2	CLIENTE V - ITAÚ	-0,3522	11,3685%	-0,0482	1,8945%	0,38%	311.429.362,07	251
3	CLIENTE V - SANTANDER	-0,3843	12,8153%	-0,0321	0,3364%	0,20%	600.174.523,11	251
4	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-0,5303	12,7019%	-0,0108	1,5319%	0,10%	712.415.881,43	251
5	CLIENTE Y - BNP	-0,5689	12,1684%	-0,0346	1,3451%	0,16%	265.914.121,36	251
6	CLIENTE V - BRADESCO	-0,7141	10,6587%	-0,0570	2,3023%	0,34%	258.802.925,21	251
7	CLIENTE X - ITAU	-0,8563	12,6081%	-0,0169	1,2970%	0,13%	1.056.823.607,14	251
8	CLIENTE D - WESTERN	-1,4431	9,6512%	-0,0970	1,9517%	0,00%	243.540.311,58	251
9	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-1,8116	9,4677%	-0,1135	1,7635%	0,35%	107.490.850,75	251
10	CLIENTE V - WESTERN	-2,1436	7,7429%	-0,1186	2,5249%	0,38%	250.675.769,60	251
11	CLIENTE X - BRADESCO	-2,2050	13,2451%	0,0280	0,4756%	0,13%	946.028.300,30	251
12	CLIENTE X - WESTERN	-2,5892	11,4321%	-0,0945	0,9382%	0,10%	952.202.623,88	251
13	CLIENTE Y - WESTERN	-2,7772	10,9799%	-0,1090	1,0470%	0,10%	266.229.651,72	251
14	CLIENTE O - SANTANDER	-4,3492	11,3151%	-0,1348	0,7078%	0,18%	355.746.434,93	251
15	CLIENTE O - BRADESCO	-5,0663	12,7660%	-0,0284	0,4831%	0,18%	336.072.024,46	251
	MÉDIA:	-1,7134	11,4349%	-0,0589	1,3326%		450.377.497,93	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/12/2022 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA, MULTIMERCADO  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO INFORMATION RATIO ANUAL  
 PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	INFORMATION RATIO	RETORNO	SHARPE	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE V - BRADESCO	0,0087	2,5657%	-0,0667	2,3360%	0,34%	258.802.925,21	62
2	CLIENTE Y - BNP	-0,8345	3,2644%	0,0141	1,1998%	0,16%	265.914.121,36	62
3	CLIENTE M - BAHIA	-1,5292	3,0135%	-0,0298	1,5167%	0,77%	92.116.081,34	62
4	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-1,9321	3,2751%	0,0170	1,1482%	0,10%	712.415.881,43	62
5	CLIENTE X - BRADESCO	-2,7973	3,3920%	0,0691	0,6977%	0,13%	946.028.300,30	62
6	CLIENTE O - BRADESCO	-3,0239	3,4194%	0,0766	0,7183%	0,18%	336.072.024,46	62
7	CLIENTE V - SANTANDER	-3,6826	2,8336%	-0,1937	0,4675%	0,20%	600.174.523,11	62
8	CLIENTE D - WESTERN	-3,8953	0,1597%	-0,2589	2,9453%	0,00%	243.540.311,58	62
9	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-3,9332	0,2253%	-0,2423	3,0777%	0,35%	107.490.850,75	62
10	CLIENTE V - ITAÚ	-3,9577	2,4011%	-0,1166	1,6956%	0,38%	311.429.362,07	62
11	CLIENTE V - WESTERN	-4,1755	-0,5850%	-0,2767	3,4431%	0,38%	250.675.769,60	62
12	CLIENTE Y - WESTERN	-4,6220	2,4412%	-0,1701	1,1062%	0,10%	266.229.651,72	62
13	CLIENTE X - WESTERN	-4,6372	2,0388%	-0,2102	1,3737%	0,10%	952.202.623,88	62
14	CLIENTE X - ITAÚ	-5,1179	3,0401%	-0,0418	0,9327%	0,13%	1.056.823.607,14	62
15	CLIENTE O - SANTANDER	-5,4338	1,9226%	-0,2538	1,2532%	0,18%	355.746.434,93	62
	MÉDIA:	-3,3042	2,2272%	-0,1123	1,5941%		450.377.497,93	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA, MULTIMERCADO  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO INFORMATION RATIO ANUAL  
 PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	INFORMATION RATIO	RETORNO	SHARPE	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE X - BRADESCO	-2,3136	1,0412%	0,1183	0,9109%	0,13%	946.028.300,30	18
2	CLIENTE O - BRADESCO	-2,6692	1,0318%	0,1013	0,9833%	0,18%	336.072.024,46	18
3	CLIENTE Y - BNP	-3,2857	0,9904%	0,0626	1,0142%	0,16%	265.914.121,36	18
4	CLIENTE V - BRADESCO	-3,4397	0,9569%	0,0203	1,7178%	0,34%	258.802.925,21	18
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-5,4161	0,9381%	0,0181	0,9798%	0,10%	712.415.881,43	18
6	CLIENTE M - BAHIA	-7,5716	0,3980%	-0,2554	1,7815%	0,77%	92.116.081,34	18
7	CLIENTE V - SANTANDER	-8,2229	0,8157%	-0,2636	0,3398%	0,20%	600.174.523,11	18
8	CLIENTE V - ITAÚ	-10,4085	0,8552%	-0,0346	1,5693%	0,38%	311.429.362,07	18
9	CLIENTE X - WESTERN	-10,6031	0,6469%	-0,2400	0,9884%	0,10%	952.202.623,88	18
10	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-10,9510	0,3902%	-0,5496	0,8417%	0,35%	107.490.850,75	18
11	CLIENTE D - WESTERN	-11,9647	0,5200%	-0,2163	1,6092%	0,00%	243.540.311,58	18
12	CLIENTE X - ITAU	-12,9633	0,7977%	-0,1550	0,6789%	0,13%	1.056.823.607,14	18
13	CLIENTE O - SANTANDER	-13,6690	0,6529%	-0,2259	1,0266%	0,18%	355.746.434,93	18
14	CLIENTE V - WESTERN	-15,1123	0,3774%	-0,2658	1,7797%	0,38%	250.675.769,60	18
15	CLIENTE Y - WESTERN	-16,4477	0,8097%	-0,1130	0,8371%	0,10%	266.229.651,72	18
	MÉDIA:	-9,0026	0,7481%	-0,1332	1,1372%		450.377.497,93	

## RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/03/2022 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA, MULTIMERCADO  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL  
 PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE X - BRADESCO	13,2451%	0,0280	0,0008%	0,4756%	0,13%	946.028.300,30	251
2	CLIENTE V - SANTANDER	12,8153%	-0,0321	-0,0007%	0,3364%	0,20%	600.174.523,11	251
3	CLIENTE O - BRADESCO	12,7660%	-0,0284	-0,0009%	0,4831%	0,18%	336.072.024,46	251
4	CLIENTE X - BNP PARIBAS	12,7019%	-0,0108	-0,0010%	1,5319%	0,10%	712.415.881,43	251
5	CLIENTE X - ITAU	12,6081%	-0,0169	-0,0014%	1,2970%	0,13%	1.056.823.607,14	251
6	CLIENTE M - BAHIA	12,6026%	-0,0160	-0,0014%	1,3895%	0,77%	92.116.081,34	251
7	CLIENTE Y - BNP	12,1684%	-0,0346	-0,0029%	1,3451%	0,16%	265.914.121,36	251
8	CLIENTE X - WESTERN	11,4321%	-0,0945	-0,0056%	0,9382%	0,10%	952.202.623,88	251
9	CLIENTE V - ITAÚ	11,3685%	-0,0482	-0,0058%	1,8945%	0,38%	311.429.362,07	251
10	CLIENTE O - SANTANDER	11,3151%	-0,1348	-0,0060%	0,7078%	0,18%	355.746.434,93	251
11	CLIENTE Y - WESTERN	10,9799%	-0,1090	-0,0072%	1,0470%	0,10%	266.229.651,72	251
12	CLIENTE V - BRADESCO	10,6587%	-0,0570	-0,0083%	2,3023%	0,34%	258.802.925,21	251
13	CLIENTE D - WESTERN	9,6512%	-0,0970	-0,0120%	1,9517%	0,00%	243.540.311,58	251
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	9,4677%	-0,1135	-0,0126%	1,7635%	0,35%	107.490.850,75	251
15	CLIENTE V - WESTERN	7,7429%	-0,1186	-0,0189%	2,5249%	0,38%	250.675.769,60	251
	MÉDIA:	11,4349%	-0,0589	-0,0056%	1,3326%		450.377.497,93	



RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/12/2022 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA, MULTIMERCADO  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL  
 PORTE SELECIONADO: N/A

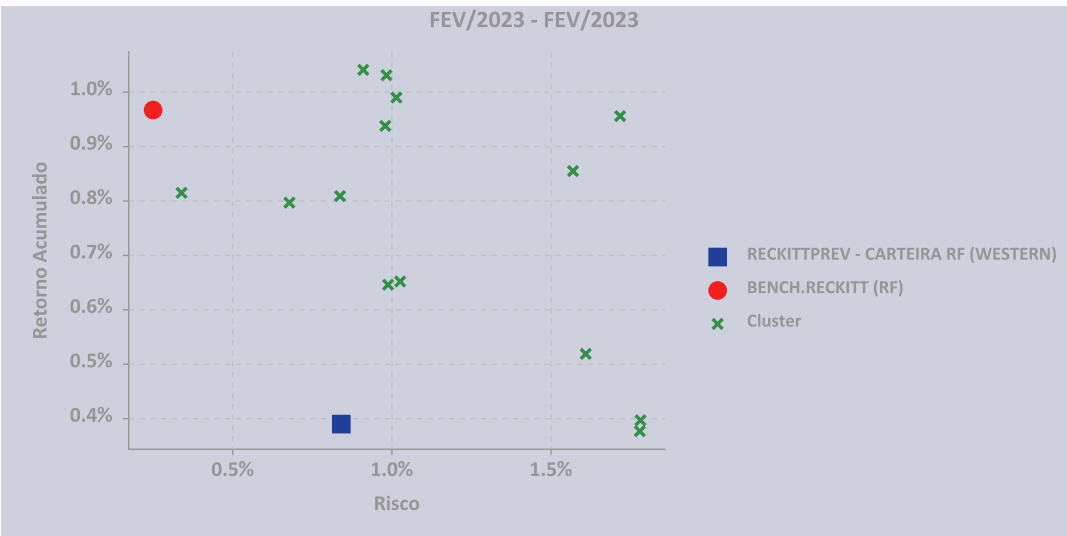
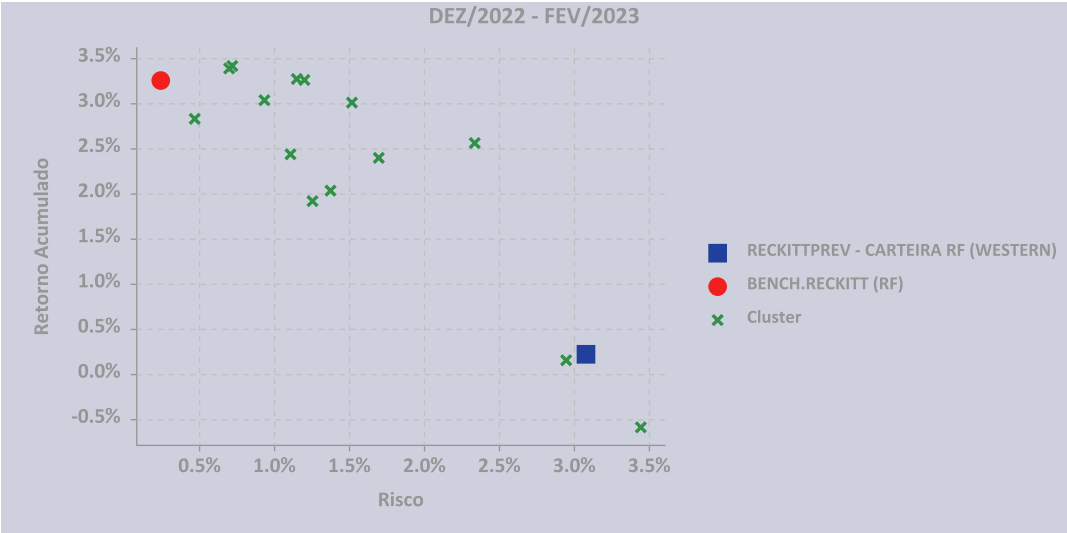
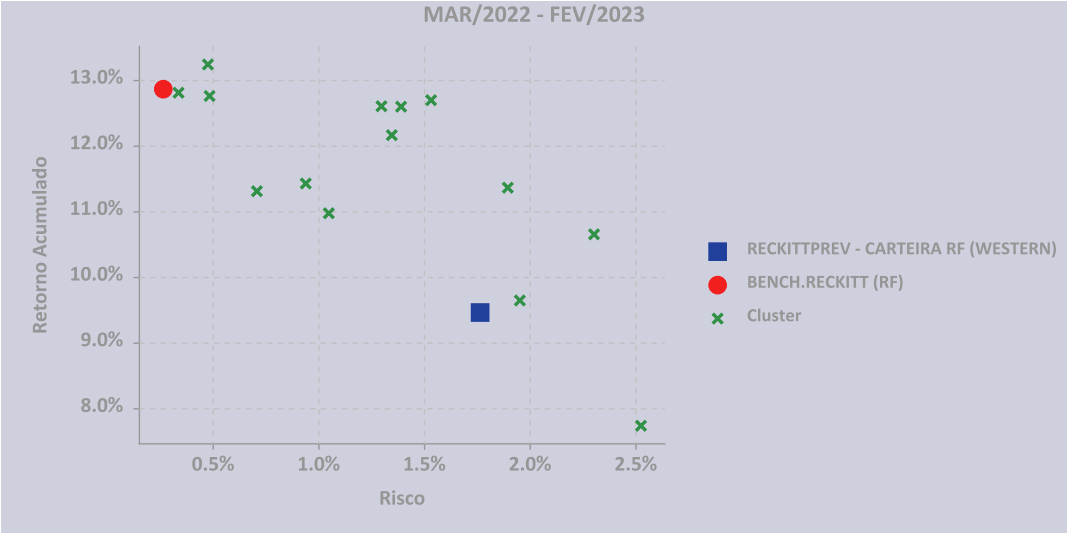
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE O - BRADESCO	3,4194%	0,0766	0,0035%	0,7183%	0,18%	336.072.024,46	62
2	CLIENTE X - BRADESCO	3,3920%	0,0691	0,0030%	0,6977%	0,13%	946.028.300,30	62
3	CLIENTE X - BNP PARIBAS	3,2751%	0,0170	0,0012%	1,1482%	0,10%	712.415.881,43	62
4	CLIENTE Y - BNP	3,2644%	0,0141	0,0011%	1,1998%	0,16%	265.914.121,36	62
5	CLIENTE X - ITAU	3,0401%	-0,0418	-0,0025%	0,9327%	0,13%	1.056.823.607,14	62
6	CLIENTE M - BAHIA	3,0135%	-0,0298	-0,0028%	1,5167%	0,77%	92.116.081,34	62
7	CLIENTE V - SANTANDER	2,8336%	-0,1937	-0,0057%	0,4675%	0,20%	600.174.523,11	62
8	CLIENTE V - BRADESCO	2,5657%	-0,0667	-0,0098%	2,3360%	0,34%	258.802.925,21	62
9	CLIENTE Y - WESTERN	2,4412%	-0,1701	-0,0119%	1,1062%	0,10%	266.229.651,72	62
10	CLIENTE V - ITAÚ	2,4011%	-0,1166	-0,0125%	1,6956%	0,38%	311.429.362,07	62
11	CLIENTE X - WESTERN	2,0388%	-0,2102	-0,0182%	1,3737%	0,10%	952.202.623,88	62
12	CLIENTE O - SANTANDER	1,9226%	-0,2538	-0,0200%	1,2532%	0,18%	355.746.434,93	62
13	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	0,2253%	-0,2423	-0,0470%	3,0777%	0,35%	107.490.850,75	62
14	CLIENTE D - WESTERN	0,1597%	-0,2589	-0,0480%	2,9453%	0,00%	243.540.311,58	62
15	CLIENTE V - WESTERN	-0,5850%	-0,2767	-0,0600%	3,4431%	0,38%	250.675.769,60	62
	MÉDIA:	2,2272%	-0,1123	-0,0153%	1,5941%		450.377.497,93	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: RENDA FIXA, MULTIMERCADO  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL  
 PORTE SELECIONADO: N/A

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE X - BRADESCO	1,0412%	0,1183	0,0068%	0,9109%	0,13%	946.028.300,30	18
2	CLIENTE O - BRADESCO	1,0318%	0,1013	0,0063%	0,9833%	0,18%	336.072.024,46	18
3	CLIENTE Y - BNP	0,9904%	0,0626	0,0040%	1,0142%	0,16%	265.914.121,36	18
4	CLIENTE V - BRADESCO	0,9569%	0,0203	0,0022%	1,7178%	0,34%	258.802.925,21	18
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	0,9381%	0,0181	0,0011%	0,9798%	0,10%	712.415.881,43	18
6	CLIENTE V - ITAÚ	0,8552%	-0,0346	-0,0034%	1,5693%	0,38%	311.429.362,07	18
7	CLIENTE V - SANTANDER	0,8157%	-0,2636	-0,0056%	0,3398%	0,20%	600.174.523,11	18
8	CLIENTE Y - WESTERN	0,8097%	-0,1130	-0,0060%	0,8371%	0,10%	266.229.651,72	18
9	CLIENTE X - ITAU	0,7977%	-0,1550	-0,0066%	0,6789%	0,13%	1.056.823.607,14	18
10	CLIENTE O - SANTANDER	0,6529%	-0,2259	-0,0146%	1,0266%	0,18%	355.746.434,93	18
11	CLIENTE X - WESTERN	0,6469%	-0,2400	-0,0149%	0,9884%	0,10%	952.202.623,88	18
12	CLIENTE D - WESTERN	0,5200%	-0,2163	-0,0219%	1,6092%	0,00%	243.540.311,58	18
13	CLIENTE M - BAHIA	0,3980%	-0,2554	-0,0287%	1,7815%	0,77%	92.116.081,34	18
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	0,3902%	-0,5496	-0,0291%	0,8417%	0,35%	107.490.850,75	18
15	CLIENTE V - WESTERN	0,3774%	-0,2658	-0,0298%	1,7797%	0,38%	250.675.769,60	18
	MÉDIA:	0,7481%	-0,1332	-0,0094%	1,1372%		450.377.497,93	

# MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: Renda Variável  
IBX*

*Fevereiro/2023*

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: IBX

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,87168  
 PATRIMÔNIO: 7.813.460,80

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: AÇÕES - IBX  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: IBX

### ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	0,35%	IBX	89,97%
	IVBX-2	6,44%	SMLL	1,28%
	IDIV	0,00%	IRF-M	1,49%
	IMA-B	0,46%		

ESTILO: 99,02%

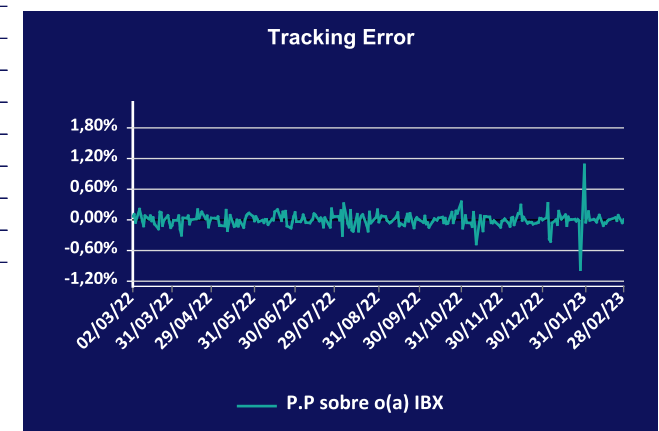
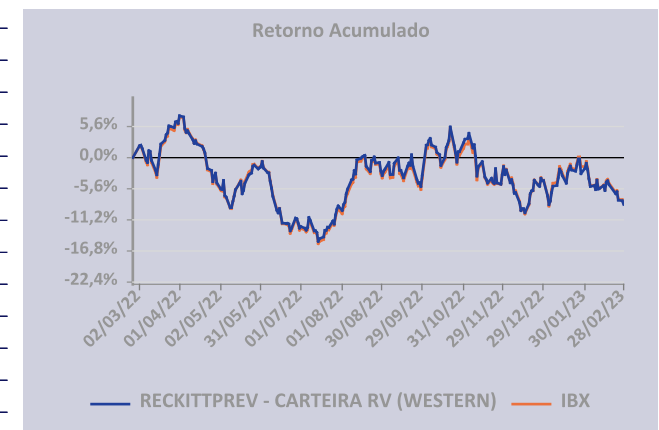
SELEÇÃO: 0,98%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0747%	29° de 33
RETORNO ACUMULADO	-8,4197%	29° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-8,2318%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1879%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0044%	14° de 33
BETA	0,9795	24° de 33
MARKET TIMING	-0,3796	28° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9887	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	32,1278%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	76,7867%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,1174	29° de 33
JENSEN	-0,6147%	29° de 33
MODIGLIANI	-0,5029%	30° de 33
SHARPE	-0,0555	30° de 33
SORTINO	-0,0743	30° de 33
TREYNOR	-0,0007	29° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	21,3941	--
DOWNSIDE RISK	1,0048%	14° de 33
RISCO ATIVO	0,1459%	9° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,3161%	9° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1433%	9° de 33
RISCO TOTAL	1,3452%	21° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	21,3553%	21° de 33

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	7
MESES NEGATIVOS	5
MESES ACIMA DO IBX	8
MESES ABAIXO DO IBX	4
MAIOR RETORNO MENSAL	6,1693%(03/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-11,0718%(06/2022)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-7,47%	-4,45%	-8,42%	-9,58%	-4,19%	5,54% (03/10/2022)	-3,53% (10/11/2022)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (08/03/2022)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)

**DADOS CADASTRAIS**

CNPJ: N/A  
 Cód. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: IBX

**SITUAÇÃO**

ÚLTIMA COTA: 1,87168  
 PATRIMÔNIO: 7.813.460,80

**SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS**

AGRUPAMENTO PPS: AÇÕES - IBX  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: IBX

**ANÁLISE DE ESTILO**

	CDI	0,00%	IBX	94,65%
	IVBX-2	0,18%	SMLL	0,00%
	IDIV	1,66%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	3,51%		

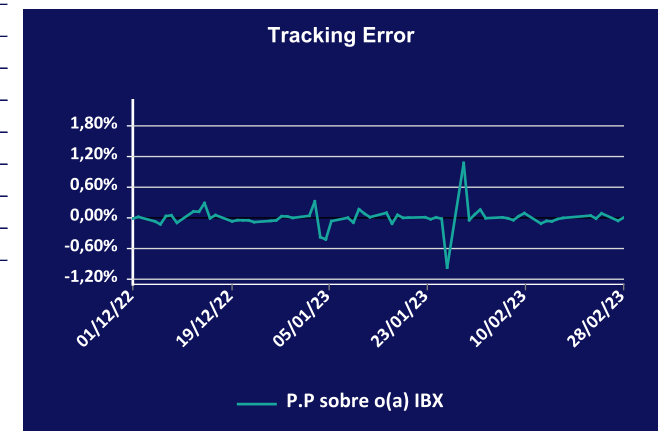
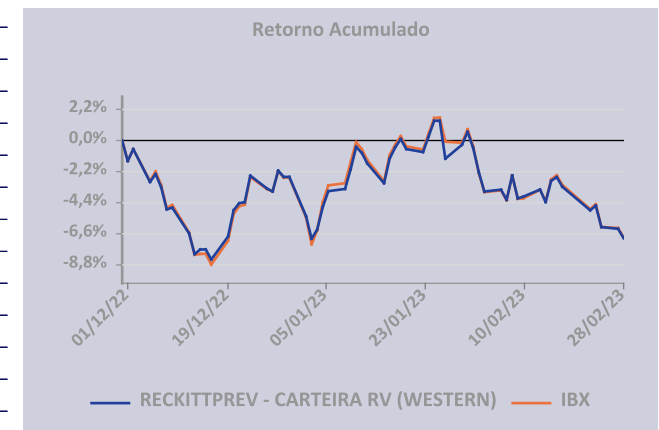
ESTILO: 96,51% | SELEÇÃO: 3,49%

**DESEMPENHO**

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1585%	33° de 33
RETORNO ACUMULADO	-6,9101%	33° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-6,8525%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,0576%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0257%	5° de 33
BETA	0,9657	29° de 33
MARKET TIMING	-2,0176	32° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9715	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	50,6121%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	77,6256%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,0871	30° de 33
JENSEN	-0,3302%	31° de 33
MODIGLIANI	-0,1866%	30° de 33
SHARPE	-0,1268	30° de 33
SORTINO	-0,1601	27° de 33
TREYNOR	-0,0016	31° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	16,9321	--
DOWNSIDE RISK	0,9895%	6° de 33
RISCO ATIVO	0,2162%	6° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	3,4335%	6° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,2135%	6° de 33
RISCO TOTAL	1,2496%	17° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	19,8377%	17° de 33

**PERFIL DE RETORNOS**

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO IBX	2
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	3,2669%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-7,4744%(02/2023)



**COMENTÁRIOS DO ANALISTA**

Campos calculados com: IBX

**QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS**

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-7,47%	-4,45%	-8,42%	-9,58%	-4,19%	1,99% (20/12/2022)	-2,84% (02/01/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	2,19% (05/01/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	2,12% (05/01/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	2,63% (20/12/2022)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	3,29% (20/12/2022)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	2,12% (17/01/2023)	-2,44% (09/02/2023)

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: IBX

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,87168  
 PATRIMÔNIO: 7.813.460,80

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: AÇÕES - IBX  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: IBX

### ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	3,67%	IBX	89,88%
	IVBX-2	6,45%	SMLL	0,00%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	0,00%		

ESTILO: 99,85%

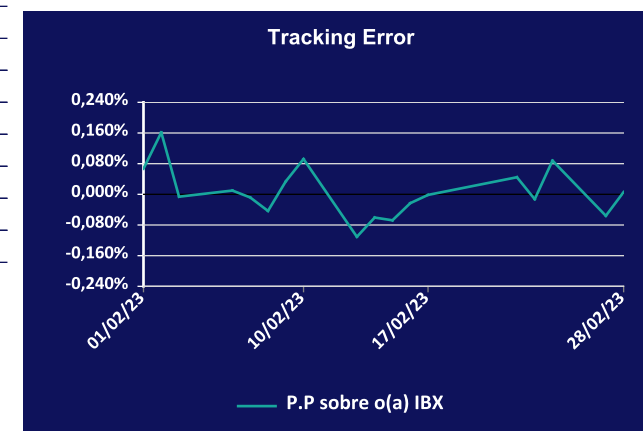
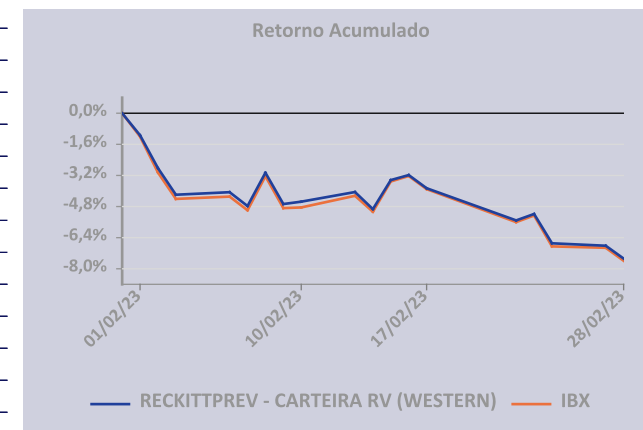
SELEÇÃO: 0,15%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,4759%	15° de 33
RETORNO ACUMULADO	-7,4743%	14° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-7,5861%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,1117%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0258%	30° de 33
BETA	0,9660	26° de 33
MARKET TIMING	1,1106	7° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9979	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	82,8524%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	72,7939%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	1,4870	23° de 33
JENSEN	-0,2138%	28° de 33
MODIGLIANI	-0,2125%	29° de 33
SHARPE	-0,4410	29° de 33
SORTINO	-0,4742	29° de 33
TREYNOR	-0,0049	28° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,6806	--
DOWNSIDE RISK	1,0036%	25° de 33
RISCO ATIVO	0,0667%	11° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,0590%	11° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0510%	11° de 33
RISCO TOTAL	1,0790%	26° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,1289%	26° de 33

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO IBX	1
MESES ABAIXO DO IBX	0
MAIOR RETORNO MENSAL	-7,4744%(02/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-7,4744%(02/2023)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-7,47%	-4,45%	-8,42%	-9,58%	-4,19%	1,80% (08/02/2023)	-1,72% (22/02/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	1,97% (08/02/2023)	-1,85% (22/02/2023)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	1,84% (08/02/2023)	-1,87% (02/02/2023)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	1,81% (15/02/2023)	-2,56% (09/02/2023)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	1,94% (15/02/2023)	-2,72% (09/02/2023)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	1,44% (08/02/2023)	-2,44% (09/02/2023)

## MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/03/2022 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO MODIGLIANI  
 PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	MODIGLIANI	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	RPS FIC FI ACOES SELECTION	5,3690%	0,9888	-3,3770%	22,3713%	1,70%	90.897.194,32	251
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	4,8304%	0,9275	-2,4606%	20,4270%	0,75%	83.412.595,93	251
3	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	4,4749%	0,8797	-2,0885%	19,5131%	0,41%	419.981.145,50	251
4	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	4,0439%	0,9393	-3,4754%	20,7714%	2,00%	325.919.861,81	251
5	OCEANA VALOR FC FI ACOES	3,9985%	0,9252	-3,3639%	20,5767%	2,00%	289.461.040,96	251
6	IAJA SAM ACOES FI	3,8989%	1,0073	-4,5768%	21,9740%	0,22%	131.152.762,13	251
7	IAJA ACOES FC FIA	2,9667%	0,9945	-5,2942%	21,7038%	0,08%	206.544.586,73	251
8	BRAM FIA IBRX ATIVO	1,6006%	0,9892	-6,4335%	21,4512%	0,00%	355.326.235,13	251
9	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	1,5789%	0,9888	-6,4502%	21,4459%	0,00%	124.465.142,59	251
10	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	1,5787%	0,9878	-6,4291%	21,4224%	0,00%	296.798.413,49	251
11	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	1,5754%	1,0250	-7,1819%	22,2484%	0,70%	29.517.484,32	251
12	MULTIPREV FIA	1,1231%	0,9781	-6,7039%	21,2333%	0,00%	676.843.656,82	251
13	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,8441%	0,9773	-6,9322%	21,1855%	0,00%	216.972.076,05	251
14	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,8150%	0,9881	-7,1902%	21,4290%	0,70%	10.691.666,76	251
15	BRADESCO FIA SALUBRE	0,7771%	0,9804	-7,0707%	21,2628%	0,50%	127.285.325,58	251
16	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,6996%	0,9894	-7,3312%	21,4573%	0,90%	194.442.132,82	251
17	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,6797%	1,0005	-7,5630%	21,6808%	0,00%	1.115.146.962,84	251
18	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,6646%	0,9823	-7,2029%	21,2856%	0,30%	34.902.664,64	251
19	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	0,5087%	0,9770	-7,2606%	21,1859%	0,00%	79.124.543,49	251
20	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,4787%	1,0000	-7,7527%	21,6689%	0,15%	170.197.962,28	251
21	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,4519%	1,0063	-7,9170%	21,8122%	0,00%	175.746.446,55	251
22	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,3327%	1,0003	-7,9049%	21,6752%	0,30%	50.721.867,31	251
23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,2683%	0,9930	-7,8174%	21,5184%	0,15%	129.714.323,28	251
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,2450%	0,9938	-7,8563%	21,5347%	0,19%	33.914.084,86	251
25	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,1595%	0,9973	-8,0155%	21,6109%	0,10%	523.352.965,82	251
26	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,1060%	0,9981	-8,1013%	21,6443%	0,56%	64.617.248,28	251
27	COMSHELL CONCHA FIA	0,0836%	0,9845	-7,8231%	21,3363%	0,17%	60.183.315,24	251
28	DAHLIA ACOES FC FIA	-0,1211%	0,9895	-9,4210%	22,7527%	1,85%	173.821.007,83	251
29	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,3148%	0,9652	-7,8111%	20,9299%	0,75%	48.022.143,57	251
30	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,5030%	0,9796	-8,4197%	21,3554%	0,35%	7.813.460,80	251
31	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,6833%	0,9967	-8,8505%	21,6054%	0,09%	372.451.365,33	251
32	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,9149%	0,9952	-9,0494%	21,5741%	0,01%	372.732.319,68	251
33	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-1,3501%	0,9749	-9,1208%	21,2271%	0,15%	61.939.645,31	251
	MÉDIA:	1,2202%	0,9818	-6,7954%	21,4203%		213.761.019,64	



## MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/12/2022 A 28/02/2023  
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO MODIGLIANI  
PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	MODIGLIANI	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	RPS FIC FI ACOES SELECTION	1,6394%	1,0781	-6,1273%	22,2744%	1,70%	90.897.194,32	62
2	DAHLIA ACOES FC FIA	1,4649%	1,0226	-5,9267%	21,3522%	1,85%	173.821.007,83	62
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	1,2048%	0,9830	-5,5198%	19,8003%	2,00%	325.919.861,81	62
4	OCEANA VALOR FC FI ACOES	1,1684%	0,9628	-5,4200%	19,4934%	2,00%	289.461.040,96	62
5	IAJA SAM ACOES FI	0,9443%	1,0109	-6,1062%	20,5277%	0,22%	131.152.762,13	62
6	IAJA ACOES FC FIA	0,8967%	1,0009	-6,0586%	20,3165%	0,08%	206.544.586,73	62
7	CITIPREVI INST FI EM ACOES	0,6713%	0,9738	-5,9456%	19,5860%	0,15%	61.939.645,31	62
8	MULTIPREV FIA	0,3902%	0,9982	-6,4673%	20,1013%	0,00%	676.843.656,82	62
9	BRAM FIA IBRX ATIVO	0,3611%	0,9817	-6,3287%	19,7535%	0,00%	355.326.235,13	62
10	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	0,3440%	0,9835	-6,3602%	19,7839%	0,00%	124.465.142,59	62
11	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	0,2816%	0,9839	-6,4262%	19,7933%	0,00%	296.798.413,49	62
12	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,2425%	1,0002	-6,6100%	20,0910%	0,00%	1.115.146.962,84	62
13	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,2266%	0,9995	-6,6145%	20,0676%	0,15%	170.197.962,28	62
14	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,2155%	0,9724	-6,3645%	19,5341%	0,30%	34.902.664,64	62
15	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,1564%	1,0000	-6,6949%	20,0884%	0,30%	50.721.867,31	62
16	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,1379%	0,9820	-6,5501%	19,7573%	0,90%	194.442.132,82	62
17	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,1351%	0,9696	-6,4187%	19,4856%	0,00%	216.972.076,05	62
18	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,1252%	1,0121	-6,8613%	20,3620%	0,70%	29.517.484,32	62
19	BRADESCO FIA SALUBRE	0,1105%	0,9733	-6,4907%	19,5829%	0,50%	127.285.325,58	62
20	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0995%	0,9959	-6,7114%	20,0070%	0,15%	129.714.323,28	62
21	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,0967%	0,9917	-6,6744%	19,9264%	0,56%	64.617.248,28	62
22	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0962%	0,9985	-6,7400%	20,0579%	0,10%	523.352.965,82	62
23	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,0847%	0,9851	-6,6301%	19,8133%	0,70%	10.691.666,76	62
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0162%	0,9949	-6,7844%	19,9868%	0,19%	33.914.084,86	62
25	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,0112%	1,0039	-6,8679%	20,1441%	0,00%	175.746.446,55	62
26	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,0324%	0,9723	-6,6168%	19,5566%	0,00%	79.124.543,49	62
27	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,0671%	0,9966	-6,8867%	20,0253%	0,09%	372.451.365,33	62
28	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,0849%	0,9960	-6,8984%	20,0136%	0,01%	372.732.319,68	62
29	COMSHELL CONCHA FIA	-0,1035%	0,9842	-6,8103%	19,8026%	0,17%	60.183.315,24	62
30	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,1866%	0,9658	-6,9102%	19,8378%	0,35%	7.813.460,80	62
31	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,2575%	0,9563	-6,6721%	19,2375%	0,75%	48.022.143,57	62
32	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-0,7433%	0,8933	-6,7312%	18,4816%	0,75%	83.412.595,93	62
33	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-1,0127%	0,8363	-6,4459%	17,5135%	0,41%	419.981.145,50	62
	MÉDIA:	0,2616%	0,9836	-6,4749%	19,8835%		213.761.019,64	

## MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/02/2023  
CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO MODIGLIANI  
PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	MODIGLIANI	BETA	RETORNO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	DAHLIA ACOES FC FIA	2,0407%	0,8690	-5,1814%	16,7886%	1,85%	173.821.007,83	18
2	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	0,8297%	0,9718	-6,5084%	17,2159%	2,00%	325.919.861,81	18
3	OCEANA VALOR FC FI ACOES	0,7327%	0,9566	-6,5000%	16,9818%	2,00%	289.461.040,96	18
4	RPS FIC FI ACOES SELECTION	0,2530%	1,1060	-8,2613%	19,7922%	1,70%	90.897.194,32	18
5	MULTIPREV FIA	0,2342%	1,0081	-7,3985%	17,8909%	0,00%	676.843.656,82	18
6	IAJA ACOES FC FIA	0,1319%	0,9709	-7,3104%	17,4851%	0,08%	206.544.586,73	18
7	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	0,1124%	0,9885	-7,4079%	17,6512%	0,00%	124.465.142,59	18
8	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,1108%	0,9961	-7,4491%	17,7352%	0,56%	64.617.248,28	18
9	BRAM FIA IBRX ATIVO	0,0828%	0,9858	-7,4157%	17,6056%	0,00%	355.326.235,13	18
10	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	0,0561%	0,9850	-7,4292%	17,5785%	0,00%	296.798.413,49	18
11	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,0544%	0,9873	-7,4443%	17,6067%	0,70%	10.691.666,76	18
12	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,0411%	0,9998	-7,5422%	17,7848%	0,00%	1.115.146.962,84	18
13	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,0290%	1,0001	-7,5562%	17,7890%	0,15%	170.197.962,28	18
14	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,0175%	0,9986	-7,5490%	17,7497%	0,15%	129.714.323,28	18
15	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,0173%	0,9860	-7,4826%	17,6099%	0,90%	194.442.132,82	18
16	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0168%	0,9999	-7,5671%	17,7861%	0,30%	50.721.867,31	18
17	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,0125%	1,0002	-7,5710%	17,7852%	0,00%	175.746.446,55	18
18	IAJA SAM ACOES FI	0,0084%	0,9825	-7,4826%	17,5917%	0,22%	131.152.762,13	18
19	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-0,0029%	0,9976	-7,5621%	17,7345%	0,19%	33.914.084,86	18
20	COMSHELL CONCHA FIA	-0,0219%	0,9866	-7,4928%	17,5505%	0,17%	60.183.315,24	18
21	SANTANDER FI IBRX ACOES	-0,0254%	0,9959	-7,5785%	17,7219%	0,10%	523.352.965,82	18
22	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,0272%	0,9589	-7,2537%	17,0408%	0,30%	34.902.664,64	18
23	BRADESCO FIA SALUBRE	-0,0287%	0,9794	-7,4762%	17,5017%	0,50%	127.285.325,58	18
24	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,0887%	1,0027	-7,6745%	17,7901%	0,09%	372.451.365,33	18
25	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,0934%	0,9700	-7,4030%	17,2186%	0,00%	216.972.076,05	18
26	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,0949%	1,0021	-7,6751%	17,7786%	0,01%	372.732.319,68	18
27	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,1771%	0,9735	-7,5074%	17,2665%	0,00%	79.124.543,49	18
28	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-0,1854%	1,0083	-7,8577%	17,9671%	0,70%	29.517.484,32	18
29	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,2125%	0,9661	-7,4744%	17,1290%	0,35%	7.813.460,80	18
30	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,2423%	0,9562	-7,4214%	16,9630%	0,75%	48.022.143,57	18
31	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,6852%	0,9129	-7,6009%	16,4929%	0,15%	61.939.645,31	18
32	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-0,6959%	0,9325	-7,6362%	16,5419%	0,75%	83.412.595,93	18
33	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-1,6240%	0,8743	-7,9311%	15,5441%	0,41%	419.981.145,50	18
	MÉDIA:	0,0174%	0,9791	-7,4122%	17,4748%		213.761.019,64	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/03/2022 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL  
 PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-2,0885%	3,6072%	0,8797	19,5131%	0,41%	419.981.145,50	251
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-2,4606%	4,2437%	0,9275	20,4270%	0,75%	83.412.595,93	251
3	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-3,3639%	3,2770%	0,9252	20,5767%	2,00%	289.461.040,96	251
4	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-3,3770%	4,6382%	0,9888	22,3713%	1,70%	90.897.194,32	251
5	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-3,4754%	3,4717%	0,9393	20,7714%	2,00%	325.919.861,81	251
6	IAJA SAM ACOES FI	-4,5768%	3,8163%	1,0073	21,9740%	0,22%	131.152.762,13	251
7	IAJA ACOES FC FIA	-5,2942%	2,8277%	0,9945	21,7038%	0,08%	206.544.586,73	251
8	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-6,4291%	1,5435%	0,9878	21,4224%	0,00%	296.798.413,49	251
9	BRAM FIA IBRX ATIVO	-6,4335%	1,5682%	0,9892	21,4512%	0,00%	355.326.235,13	251
10	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-6,4502%	1,5446%	0,9888	21,4459%	0,00%	124.465.142,59	251
11	MULTIPREV FIA	-6,7039%	1,0650%	0,9781	21,2333%	0,00%	676.843.656,82	251
12	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-6,9322%	0,8167%	0,9773	21,1855%	0,00%	216.972.076,05	251
13	BRADESCO FIA SALUBRE	-7,0707%	0,7448%	0,9804	21,2628%	0,50%	127.285.325,58	251
14	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-7,1819%	1,5808%	1,0250	22,2484%	0,70%	29.517.484,32	251
15	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-7,1902%	0,7880%	0,9881	21,4290%	0,70%	10.691.666,76	251
16	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-7,2029%	0,6514%	0,9823	21,2856%	0,30%	34.902.664,64	251
17	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-7,2606%	0,4845%	0,9770	21,1859%	0,00%	79.124.543,49	251
18	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-7,3312%	0,6765%	0,9894	21,4573%	0,90%	194.442.132,82	251
19	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-7,5630%	0,6799%	1,0005	21,6808%	0,00%	1.115.146.962,84	251
20	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-7,7527%	0,4784%	1,0000	21,6689%	0,15%	170.197.962,28	251
21	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-7,8111%	-0,3179%	0,9652	20,9299%	0,75%	48.022.143,57	251
22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-7,8174%	0,2658%	0,9930	21,5184%	0,15%	129.714.323,28	251
23	COMSHELL CONCHA FIA	-7,8231%	0,0806%	0,9845	21,3363%	0,17%	60.183.315,24	251
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-7,8563%	0,2430%	0,9938	21,5347%	0,19%	33.914.084,86	251
25	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-7,9049%	0,3326%	1,0003	21,6752%	0,30%	50.721.867,31	251
26	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-7,9170%	0,4491%	1,0063	21,8122%	0,00%	175.746.446,55	251
27	SANTANDER FI IBRX ACOES	-8,0155%	0,1588%	0,9973	21,6109%	0,10%	523.352.965,82	251
28	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-8,1013%	0,0917%	0,9981	21,6443%	0,56%	64.617.248,28	251
29	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-8,4197%	-0,6148%	0,9796	21,3554%	0,35%	7.813.460,80	251
30	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-8,8505%	-0,6857%	0,9967	21,6054%	0,09%	372.451.365,33	251
31	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-9,0494%	-0,9166%	0,9952	21,5741%	0,01%	372.732.319,68	251
32	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-9,1208%	-1,4193%	0,9749	21,2271%	0,15%	61.939.645,31	251
33	DAHLIA ACOES FC FIA	-9,4210%	-1,3873%	0,9895	22,7527%	1,85%	173.821.007,83	251
	MÉDIA:	-6,7954%	1,0541%	0,9818	21,4203%		213.761.019,64	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/12/2022 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL  
 PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

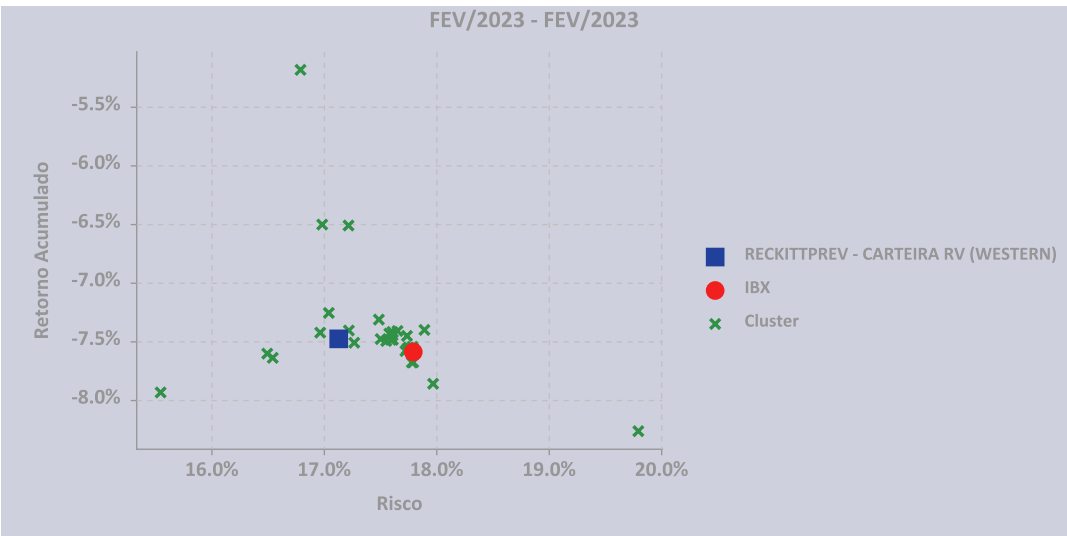
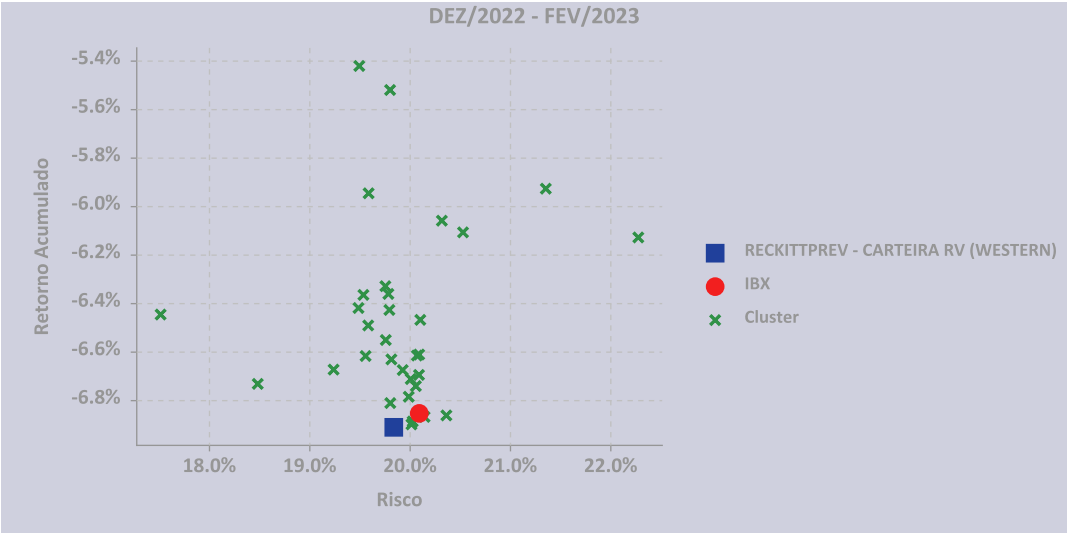
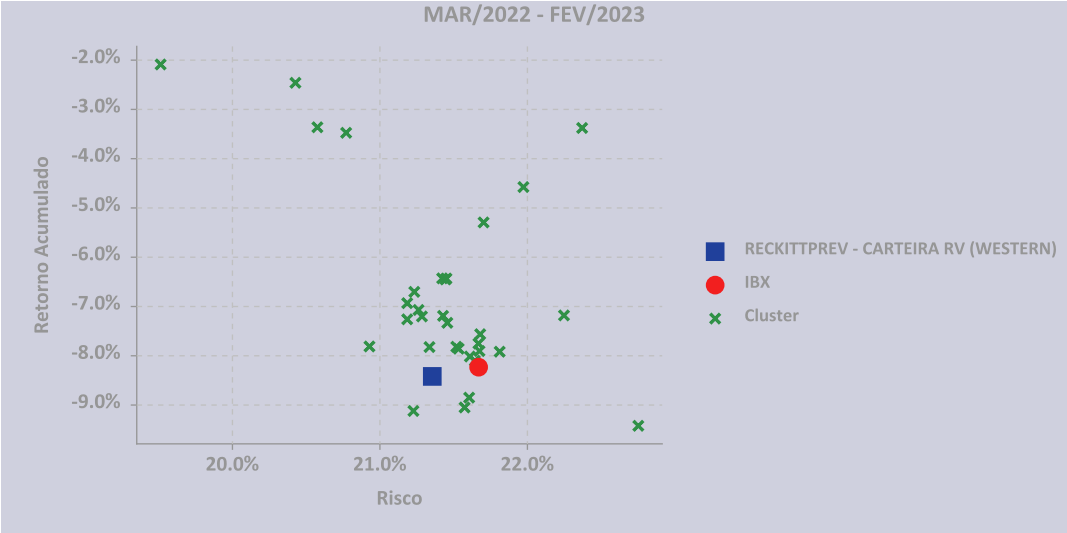
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-5,4200%	0,9680%	0,9628	19,4934%	2,00%	289.461.040,96	62
2	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-5,5198%	1,0833%	0,9830	19,8003%	2,00%	325.919.861,81	62
3	DAHLIA ACOES FC FIA	-5,9267%	1,2190%	1,0226	21,3522%	1,85%	173.821.007,83	62
4	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-5,9456%	0,6238%	0,9738	19,5860%	0,15%	61.939.645,31	62
5	IAJA ACOES FC FIA	-6,0586%	0,8440%	1,0009	20,3165%	0,08%	206.544.586,73	62
6	IAJA SAM ACOES FI	-6,1062%	0,9116%	1,0109	20,5277%	0,22%	131.152.762,13	62
7	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-6,1273%	1,4145%	1,0781	22,2744%	1,70%	90.897.194,32	62
8	BRAM FIA IBRX ATIVO	-6,3287%	0,3524%	0,9817	19,7535%	0,00%	355.326.235,13	62
9	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-6,3602%	0,3358%	0,9835	19,7839%	0,00%	124.465.142,59	62
10	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-6,3645%	0,2086%	0,9724	19,5341%	0,30%	34.902.664,64	62
11	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-6,4187%	0,1286%	0,9696	19,4856%	0,00%	216.972.076,05	62
12	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-6,4262%	0,2748%	0,9839	19,7933%	0,00%	296.798.413,49	62
13	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-6,4459%	-1,1191%	0,8363	17,5135%	0,41%	419.981.145,50	62
14	MULTIPREV FIA	-6,4673%	0,3774%	0,9982	20,1013%	0,00%	676.843.656,82	62
15	BRADESCO FIA SALUBRE	-6,4907%	0,1045%	0,9733	19,5829%	0,50%	127.285.325,58	62
16	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-6,5501%	0,1329%	0,9820	19,7573%	0,90%	194.442.132,82	62
17	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-6,6100%	0,2424%	1,0002	20,0910%	0,00%	1.115.146.962,84	62
18	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-6,6145%	0,2262%	0,9995	20,0676%	0,15%	170.197.962,28	62
19	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-6,6168%	-0,0351%	0,9723	19,5566%	0,00%	79.124.543,49	62
20	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-6,6301%	0,0810%	0,9851	19,8133%	0,70%	10.691.666,76	62
21	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-6,6721%	-0,2501%	0,9563	19,2375%	0,75%	48.022.143,57	62
22	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-6,6744%	0,0936%	0,9917	19,9264%	0,56%	64.617.248,28	62
23	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-6,6949%	0,1562%	1,0000	20,0884%	0,30%	50.721.867,31	62
24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-6,7114%	0,0989%	0,9959	20,0070%	0,15%	129.714.323,28	62
25	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-6,7312%	-0,9207%	0,8933	18,4816%	0,75%	83.412.595,93	62
26	SANTANDER FI IBRX ACOES	-6,7400%	0,0959%	0,9985	20,0579%	0,10%	523.352.965,82	62
27	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-6,7844%	0,0159%	0,9949	19,9868%	0,19%	33.914.084,86	62
28	COMSHELL CONCHA FIA	-6,8103%	-0,1027%	0,9842	19,8026%	0,17%	60.183.315,24	62
29	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-6,8613%	0,1161%	1,0121	20,3620%	0,70%	29.517.484,32	62
30	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-6,8679%	0,0095%	1,0039	20,1441%	0,00%	175.746.446,55	62
31	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-6,8867%	-0,0703%	0,9966	20,0253%	0,09%	372.451.365,33	62
32	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-6,8984%	-0,0880%	0,9960	20,0136%	0,01%	372.732.319,68	62
33	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-6,9102%	-0,3303%	0,9658	19,8378%	0,35%	7.813.460,80	62
	MÉDIA:	-6,4749%	0,2181%	0,9836	19,8835%		213.761.019,64	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2023 A 28/02/2023  
 CLASSIFICAÇÃO: AÇÕES  
 PERIODICIDADE DE RETORNOS: DIÁRIA  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO  
 CRITÉRIO DE CLASSIFICAÇÃO: DECRESCENTE PELO RETORNO TOTAL  
 PORTE SELECIONADO: PATRIMÔNIO SUPERIOR A R\$ 10.000.000

RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	DAHLIA ACOES FC FIA	-5,1814%	1,5653%	0,8690	16,7886%	1,85%	173.821.007,83	18
2	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-6,5000%	0,6103%	0,9566	16,9818%	2,00%	289.461.040,96	18
3	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-6,5084%	0,7088%	0,9718	17,2159%	2,00%	325.919.861,81	18
4	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-7,2537%	-0,0270%	0,9589	17,0408%	0,30%	34.902.664,64	18
5	IAJA ACOES FC FIA	-7,3104%	0,0423%	0,9709	17,4851%	0,08%	206.544.586,73	18
6	MULTIPREV FIA	-7,3985%	0,2164%	1,0081	17,8909%	0,00%	676.843.656,82	18
7	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-7,4030%	-0,0918%	0,9700	17,2186%	0,00%	216.972.076,05	18
8	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-7,4079%	0,1094%	0,9885	17,6512%	0,00%	124.465.142,59	18
9	BRAM FIA IBRX ATIVO	-7,4157%	0,0802%	0,9858	17,6056%	0,00%	355.326.235,13	18
10	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-7,4214%	-0,2337%	0,9562	16,9630%	0,75%	48.022.143,57	18
11	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-7,4292%	0,0533%	0,9850	17,5785%	0,00%	296.798.413,49	18
12	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-7,4443%	0,0522%	0,9873	17,6067%	0,70%	10.691.666,76	18
13	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-7,4491%	0,1091%	0,9961	17,7352%	0,56%	64.617.248,28	18
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-7,4744%	-0,2138%	0,9661	17,1290%	0,35%	7.813.460,80	18
15	BRADESCO FIA SALUBRE	-7,4762%	-0,0307%	0,9794	17,5017%	0,50%	127.285.325,58	18
16	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-7,4826%	0,0153%	0,9860	17,6099%	0,90%	194.442.132,82	18
17	IAJA SAM ACOES FI	-7,4826%	-0,0651%	0,9825	17,5917%	0,22%	131.152.762,13	18
18	COMSHELL CONCHA FIA	-7,4928%	-0,0216%	0,9866	17,5505%	0,17%	60.183.315,24	18
19	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-7,5074%	-0,1748%	0,9735	17,2665%	0,00%	79.124.543,49	18
20	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-7,5422%	0,0411%	0,9998	17,7848%	0,00%	1.115.146.962,84	18
21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-7,5490%	0,0174%	0,9986	17,7497%	0,15%	129.714.323,28	18
22	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-7,5562%	0,0290%	1,0001	17,7890%	0,15%	170.197.962,28	18
23	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-7,5621%	-0,0030%	0,9976	17,7345%	0,19%	33.914.084,86	18
24	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-7,5671%	0,0168%	0,9999	17,7861%	0,30%	50.721.867,31	18
25	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-7,5710%	0,0106%	1,0002	17,7852%	0,00%	175.746.446,55	18
26	SANTANDER FI IBRX ACOES	-7,5785%	-0,0254%	0,9959	17,7219%	0,10%	523.352.965,82	18
27	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-7,6009%	-0,6514%	0,9129	16,4929%	0,15%	61.939.645,31	18
28	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-7,6362%	-0,7460%	0,9325	16,5419%	0,75%	83.412.595,93	18
29	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-7,6745%	-0,0932%	1,0027	17,7901%	0,09%	372.451.365,33	18
30	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-7,6751%	-0,0993%	1,0021	17,7786%	0,01%	372.732.319,68	18
31	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-7,8577%	-0,1958%	1,0083	17,9671%	0,70%	29.517.484,32	18
32	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-7,9311%	-1,5556%	0,8743	15,5441%	0,41%	419.981.145,50	18
33	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-8,2613%	-0,2950%	1,1060	19,7922%	1,70%	90.897.194,32	18
	MÉDIA:	-7,4122%	-0,0256%	0,9791	17,4748%		213.761.019,64	

# MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: -.-  
MULTIMERCADOS*

*Fevereiro/2023*

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA ESTRUTURADO  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (EST.)

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,80334  
 PATRIMÔNIO: 15.836.958,72

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (EST.)

### ANÁLISE DE ESTILO

CDI	90,19%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,26%	SMLL	1,23%
IDIV	0,00%	IRF-M	4,84%
IMA B 5	3,48%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 36,75%

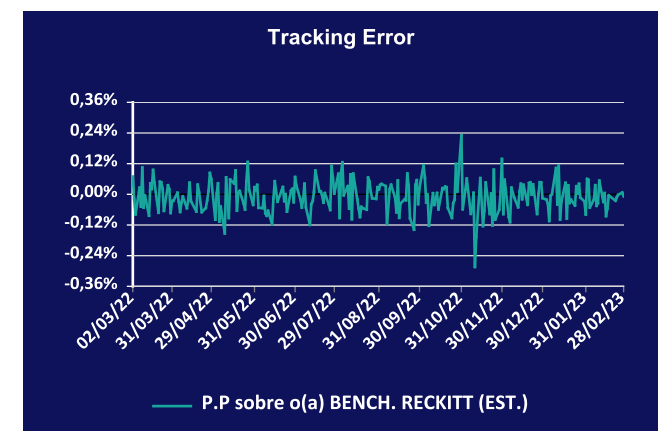
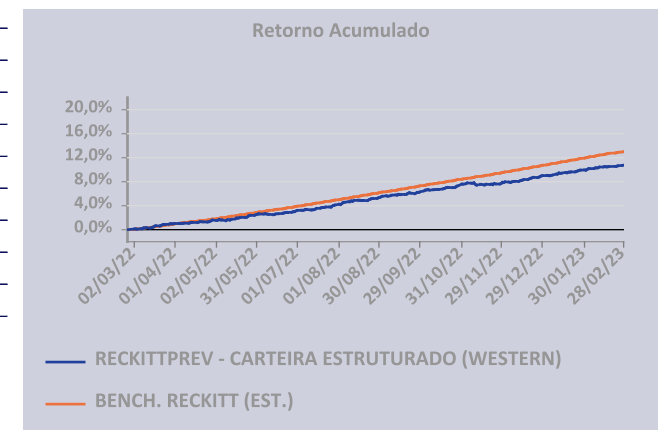
SELEÇÃO: 63,25%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0080%	--
RETORNO ACUMULADO	10,7581%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	13,0099%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,2518%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0146	--
SHARPE	-0,1282	--
SORTINO	-0,1630	--
STERLING RATIO	-0,1613	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,3537	--
DOWNSIDE RISK	0,0490%	--
RISCO ATIVO	0,0624%	--
RISCO TOTAL	0,0624%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,9913%	--

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (EST.)	3
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (EST.)	9
MAIOR RETORNO MENSAL	1,2183%(10/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	0,2672%(11/2022)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (EST.), vide composição na capa.

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,76%	1,62%	10,76%	12,41%	15,69%	0,28% (31/10/2022)	-0,23% (10/11/2022)
BENCH. RECKITT (EST.)	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (08/03/2022)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (08/03/2022)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)



**DADOS CADASTRAIS**

CNPJ: N/A  
 Cód. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA ESTRUTURADO  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (EST.)

**SITUAÇÃO**

ÚLTIMA COTA: 1,80334  
 PATRIMÔNIO: 15.836.958,72

**SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS**

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (EST.)

**ANÁLISE DE ESTILO**

CDI	94,66%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,02%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	1,22%
IMA-C	4,10%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 9,19%

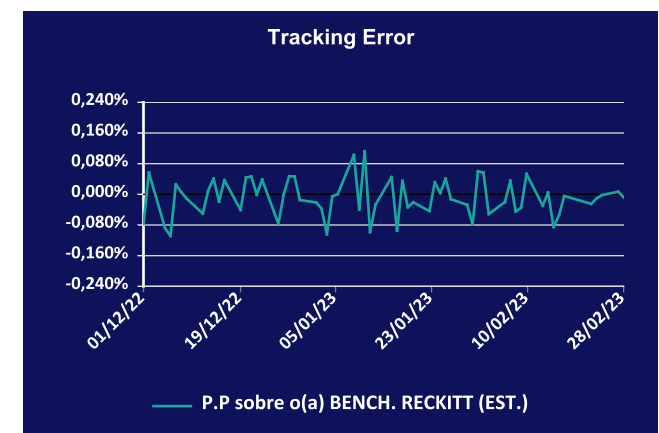
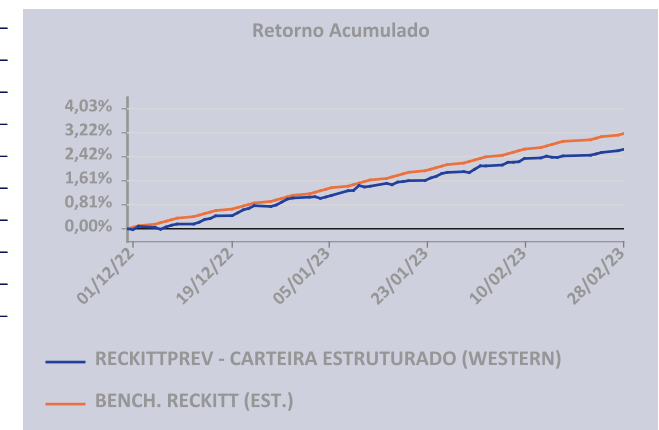
SELEÇÃO: 90,81%

**DESEMPENHO**

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0083%	--
RETORNO ACUMULADO	2,6662%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,1981%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,5319%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0587	--
SHARPE	-0,1669	--
SORTINO	-0,2084	--
STERLING RATIO	-0,2059	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,5584	--
DOWNSIDE RISK	0,0399%	--
RISCO ATIVO	0,0498%	--
RISCO TOTAL	0,0498%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,7918%	--

**PERFIL DE RETORNOS**

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (EST.)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (EST.)	3
MAIOR RETORNO MENSAL	1,0333%(12/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	0,7631%(02/2023)



**COMENTÁRIOS DO ANALISTA**

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (EST.), vide composição na capa.

**QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS**

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,76%	1,62%	10,76%	12,41%	15,69%	0,16% (11/01/2023)	-0,06% (06/12/2022)
BENCH. RECKITT (EST.)	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/02/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	2,19% (05/01/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	2,12% (05/01/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	2,63% (20/12/2022)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	3,29% (20/12/2022)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	2,12% (17/01/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,49% (20/12/2022)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,31% (12/12/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,37% (15/02/2023)	-0,26% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)

### DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA ESTRUTURADO  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (EST.)

### SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 1,80334  
 PATRIMÔNIO: 15.836.958,72

### SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (EST.)

### ANÁLISE DE ESTILO

CDI	100,00%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 0,00%

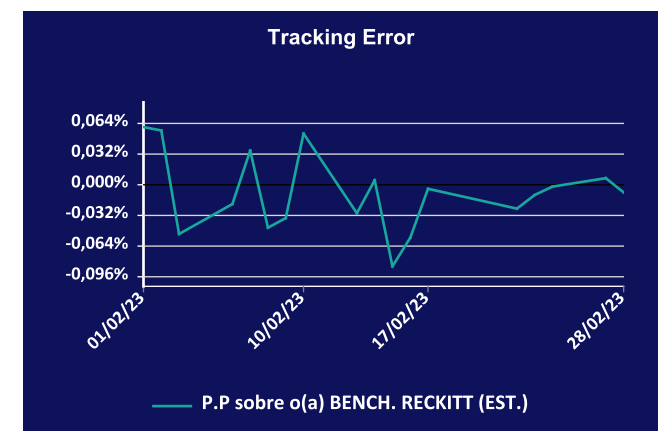
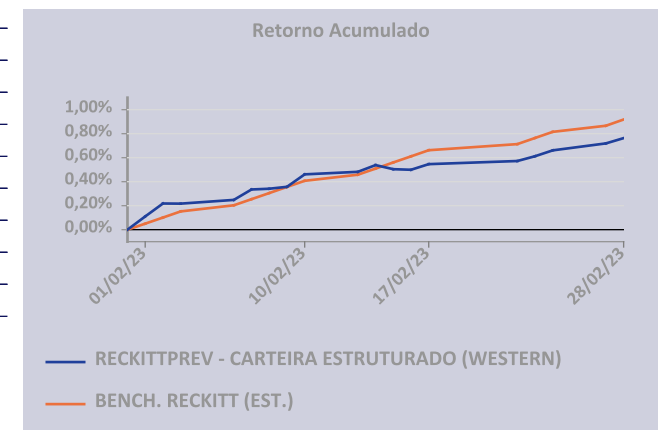
SELEÇÃO: 100,00%

### DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0085%	--
RETORNO ACUMULADO	0,7630%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,9181%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,1550%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,2181	--
SHARPE	-0,2104	--
SORTINO	-0,2679	--
STERLING RATIO	-0,4294	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,1323	--
DOWNSIDE RISK	0,0318%	--
RISCO ATIVO	0,0405%	--
RISCO TOTAL	0,0405%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,6440%	--

### PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (EST.)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (EST.)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	0,7631%(02/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,7631%(02/2023)



### COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (EST.), vide composição na capa.

### QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,76%	1,62%	10,76%	12,41%	15,69%	0,11% (01/02/2023)	-0,03% (15/02/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	1,97% (08/02/2023)	-1,85% (22/02/2023)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	1,84% (08/02/2023)	-1,87% (02/02/2023)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	1,81% (15/02/2023)	-2,56% (09/02/2023)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	1,94% (15/02/2023)	-2,72% (09/02/2023)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	1,44% (08/02/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
IMA-GERAL	1,03%	1,74%	10,51%	13,70%	17,46%	0,37% (15/02/2023)	-0,21% (03/02/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)



*Agrupamento: -.-  
INVEST. NO EXTERIOR*

*Fevereiro/2023*

**DADOS CADASTRAIS**

CNPJ: N/A  
 Cód. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA INV. EXTERIOR  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (IE)

**SITUAÇÃO**

ÚLTIMA COTA: 2,61353  
 PATRIMÔNIO: 9.560.813,75

**SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS**

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (IE)

**ANÁLISE DE ESTILO**

S&P 500	0,00%	MSCI WORLD	67,18%
DÓLAR PTAX	32,82%		

ESTILO: 58,75%

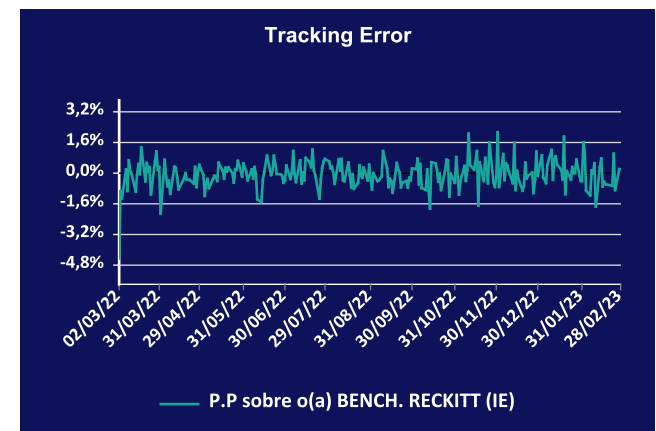
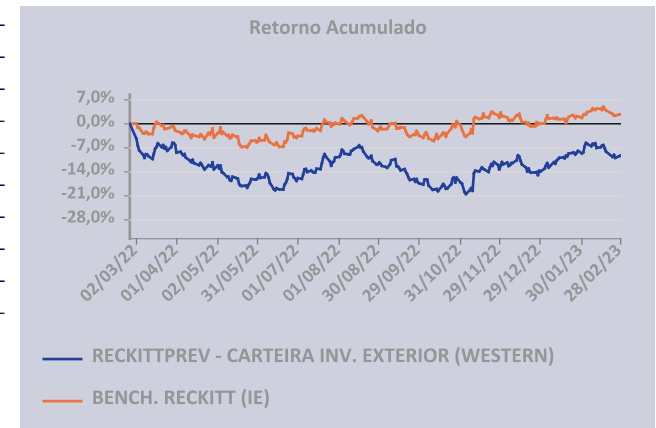
SELEÇÃO: 41,25%

**DESEMPENHO**

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0811%	--
RETORNO ACUMULADO	-9,2562%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,7285%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-11,9847%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0045	--
SHARPE	-0,0721	--
SORTINO	-0,0987	--
STERLING RATIO	-0,0504	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	7,8899	--
DOWNSIDE RISK	0,8215%	--
RISCO ATIVO	0,7318%	--
RISCO TOTAL	1,1248%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	17,8565%	--

**PERFIL DE RETORNOS**

MESES POSITIVOS	4
MESES NEGATIVOS	8
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	4
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	8
MAIOR RETORNO MENSAL	8,1428%(07/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-7,5309%(04/2022)



**COMENTÁRIOS DO ANALISTA**

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (IE), vide composição na capa.

**QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS**

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-1,03%	5,38%	-9,26%	-10,14%	18,44%	6,32% (10/11/2022)	-4,41% (02/03/2022)
BENCH. RECKITT (IE)	0,21%	2,69%	2,73%	9,77%	41,73%	4,26% (10/11/2022)	-2,68% (29/04/2022)
MSCI EUROPE	-0,76%	7,78%	-3,90%	0,64%	18,63%	6,22% (09/03/2022)	-4,79% (04/03/2022)
MSCI WORLD	-2,53%	4,30%	-8,91%	-0,45%	26,78%	5,05% (10/11/2022)	-3,66% (13/09/2022)
DÓLAR D2	2,69%	-1,21%	1,18%	-6,46%	16,05%	4,38% (22/04/2022)	-3,87% (03/10/2022)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)
EURO PTAX	-0,26%	-0,81%	-4,43%	-17,72%	11,77%	4,34% (10/11/2022)	-3,57% (03/10/2022)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-0,45%	4,10%	-7,70%	-6,26%	46,77%	7,97% (10/11/2022)	-4,10% (29/04/2022)
MSCI WORLD - BRL D2	0,10%	3,04%	-7,84%	-6,88%	47,13%	8,97% (10/11/2022)	-3,74% (26/08/2022)
S&P 500	-2,61%	3,40%	-9,45%	4,17%	34,39%	5,54% (10/11/2022)	-4,32% (13/09/2022)
S&P 500 BRL PTAX	-0,54%	3,21%	-8,25%	-1,90%	55,57%	8,48% (10/11/2022)	-5,40% (29/04/2022)

**DADOS CADASTRAIS**

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA INV. EXTERIOR  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (IE)

**SITUAÇÃO**

ÚLTIMA COTA: 2,61353  
 PATRIMÔNIO: 9.560.813,75

**SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS**

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (IE)

**ANÁLISE DE ESTILO**

S&P 500	0,00%	MSCI WORLD	78,98%
DÓLAR PTAX	21,02%		

ESTILO: 60,50%

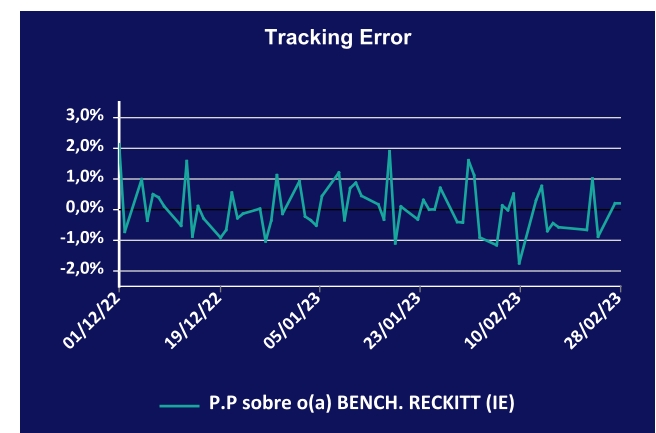
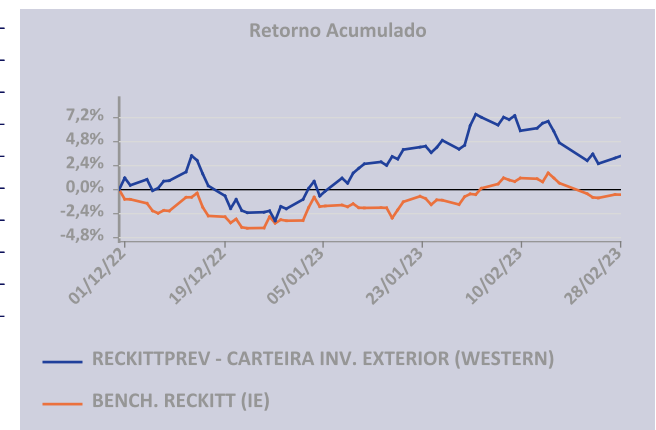
SELEÇÃO: 39,50%

**DESEMPENHO**

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0062%	--
RETORNO ACUMULADO	3,3613%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	-0,4999%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	3,8613%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0008	--
SHARPE	0,0072	--
SORTINO	0,0099	--
STERLING RATIO	0,0049	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,9009	--
DOWNSIDE RISK	0,6284%	--
RISCO ATIVO	0,7898%	--
RISCO TOTAL	0,8661%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	13,7502%	--

**PERFIL DE RETORNOS**

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	6,4745%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,9116%(12/2022)



**COMENTÁRIOS DO ANALISTA**

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (IE), vide composição na capa.

**QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS**

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-1,03%	5,38%	-9,26%	-10,14%	18,44%	1,89% (01/02/2023)	-1,71% (22/02/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	0,21%	2,69%	2,73%	9,77%	41,73%	1,39% (12/12/2022)	-1,42% (15/12/2022)
MSCI EUROPE	-0,76%	7,78%	-3,90%	0,64%	18,63%	2,69% (01/12/2022)	-2,81% (15/12/2022)
MSCI WORLD	-2,53%	4,30%	-8,91%	-0,45%	26,78%	2,12% (06/01/2023)	-2,53% (15/12/2022)
DÓLAR D2	2,69%	-1,21%	1,18%	-6,46%	16,05%	2,21% (03/02/2023)	-2,22% (06/01/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)
EURO PTAX	-0,26%	-0,81%	-4,43%	-17,72%	11,77%	2,31% (02/01/2023)	-1,57% (05/01/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-0,45%	4,10%	-7,70%	-6,26%	46,77%	2,59% (02/01/2023)	-2,94% (15/12/2022)
MSCI WORLD - BRL D2	0,10%	3,04%	-7,84%	-6,88%	47,13%	2,31% (12/12/2022)	-2,70% (05/01/2023)
S&P 500	-2,61%	3,40%	-9,45%	4,17%	34,39%	2,28% (06/01/2023)	-2,49% (15/12/2022)
S&P 500 BRL PTAX	-0,54%	3,21%	-8,25%	-1,90%	55,57%	2,72% (12/12/2022)	-2,90% (15/12/2022)

**DADOS CADASTRAIS**

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA INV. EXTERIOR  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: MULTIMERCADO  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (IE)

**SITUAÇÃO**

ÚLTIMA COTA: 2,61353  
 PATRIMÔNIO: 9.560.813,75

**SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS**

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (IE)

**ANÁLISE DE ESTILO**

S&P 500	0,00%	MSCI WORLD	90,33%
DÓLAR PTAX	9,67%		

ESTILO: 59,02%

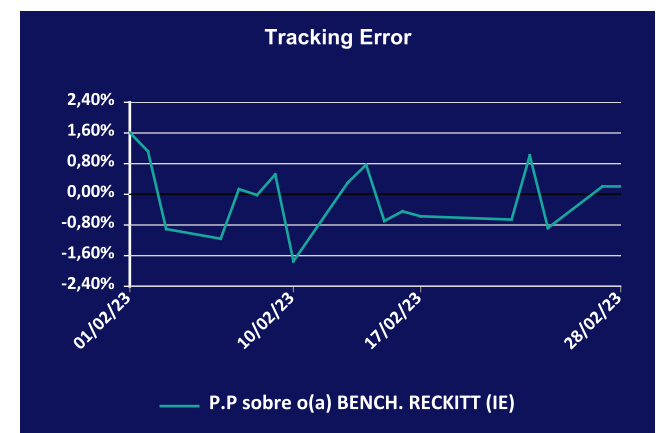
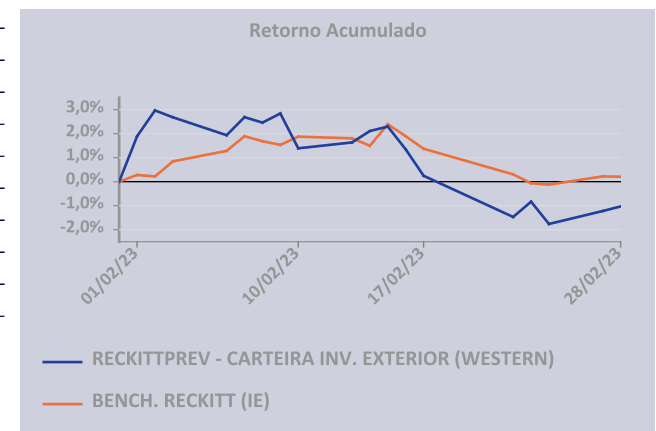
SELEÇÃO: 40,98%

**DESEMPENHO**

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1042%	--
RETORNO ACUMULADO	-1,0318%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,2068%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,2387%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0243	--
SHARPE	-0,1114	--
SORTINO	-0,1454	--
STERLING RATIO	-0,0704	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,0522	--
DOWNSIDE RISK	0,7170%	--
RISCO ATIVO	0,8841%	--
RISCO TOTAL	0,9354%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	14,8504%	--

**PERFIL DE RETORNOS**

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	-1,0319%(02/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-1,0319%(02/2023)



**COMENTÁRIOS DO ANALISTA**

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (IE), vide composição na capa.

**QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS**

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-1,03%	5,38%	-9,26%	-10,14%	18,44%	1,89% (01/02/2023)	-1,71% (22/02/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	0,21%	2,69%	2,73%	9,77%	41,73%	0,88% (15/02/2023)	-1,05% (22/02/2023)
MSCI EUROPE	-0,76%	7,78%	-3,90%	0,64%	18,63%	1,63% (27/02/2023)	-1,90% (06/02/2023)
MSCI WORLD	-2,53%	4,30%	-8,91%	-0,45%	26,78%	1,35% (02/02/2023)	-1,54% (21/02/2023)
DÓLAR D2	2,69%	-1,21%	1,18%	-6,46%	16,05%	2,21% (03/02/2023)	-1,31% (02/02/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)
EURO PTAX	-0,26%	-0,81%	-4,43%	-17,72%	11,77%	1,53% (03/02/2023)	-1,46% (02/02/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	-0,45%	4,10%	-7,70%	-6,26%	46,77%	1,53% (15/02/2023)	-2,30% (22/02/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	0,10%	3,04%	-7,84%	-6,88%	47,13%	1,24% (03/02/2023)	-1,86% (22/02/2023)
S&P 500	-2,61%	3,40%	-9,45%	4,17%	34,39%	1,47% (02/02/2023)	-2,16% (22/02/2023)
S&P 500 BRL PTAX	-0,54%	3,21%	-8,25%	-1,90%	55,57%	1,71% (15/02/2023)	-2,16% (22/02/2023)

2021 | BENCH. RECKITT (TOTAL): 65.00% (SELIC + 1.50% ao ano) + 15.00% IBrX-100 + 15.00% CDI + 5.00% S&P 500 (R\$)  
2022 | BENCH. RECKITT (TOTAL) DE 03.01.22 A 15.03.22: 64.35% SELIC + 7.15% IMA-B5 + 8.50% IBrX-100 + 15.00% CDI + 5.00% S&P 500 (R\$)  
2022 | BENCH. RECKITT (TOTAL) DE 16.03.22 A 31.12.22: 67.05% SELIC + 7.45% IMA-B5 + 8.50% IBrX-100 + 13.50% CDI + 3.50% S&P 500 (R\$)  
2023 | BENCH. RECKITT (TOTAL): 68.85% SELIC + 7.65% IMA-B5 + 6.00% IBrX-100 + 14.25% CDI + 3.25% S&P 500 (R\$)



*Agrupamento: -.-  
CONSOLIDADO (Gestão Ativa)*

*Fevereiro/2023*

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 Cód. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA TOTAL (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: -  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (TOTAL)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,41578  
 PATRIMÔNIO: 140.702.084,02

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (TOTAL)

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	IBX	IBX	4,42%
	87,38%			
	2,48%	SMLL		2,74%
	0,00%	IRF-M		1,44%
	0,00%	IMA B 5+		0,00%
	0,00%	DÓLAR PTAX		1,53%

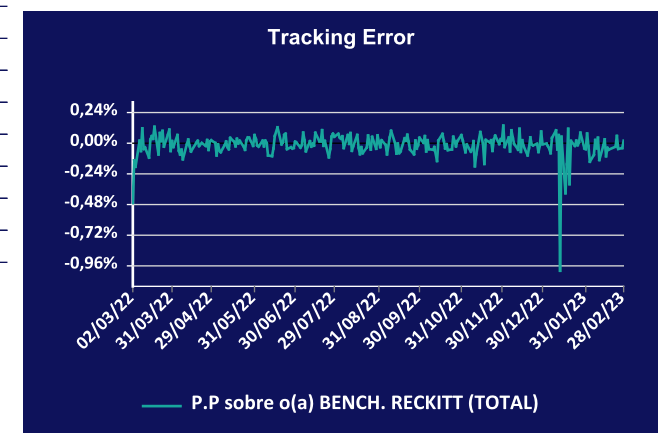
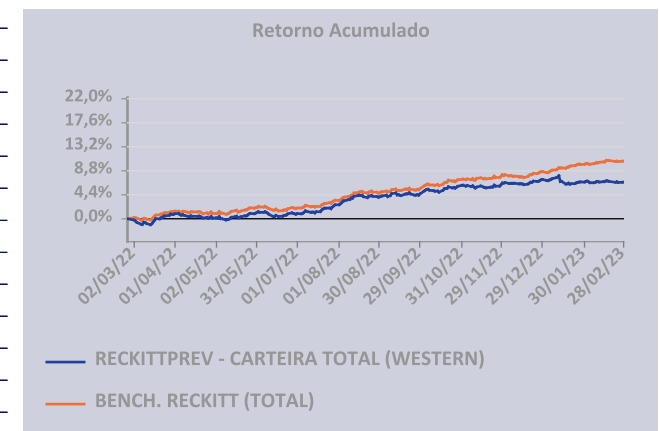
ESTILO: 63,79% | SELEÇÃO: 36,21%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0226%	--
RETORNO ACUMULADO	6,7152%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,5602%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,8450%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0134%	--
BETA	0,0948	--
MARKET TIMING	-0,1233	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5800	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	89,0880%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	38,5491%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-2,3330	--
JENSEN	-4,2765%	--
MODIGLIANI	-29,1959%	--
SHARPE	-0,1333	--
SORTINO	-0,1611	--
TREYNOR	-0,0023	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	48,4727	--
DOWNSIDE RISK	0,1408%	--
RISCO ATIVO	0,0956%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,5183%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1104%	--
RISCO TOTAL	0,1703%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,7043%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	8
MESES NEGATIVOS	4
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	3
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	9
MAIOR RETORNO MENSAL	1,6980%(07/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-0,6501%(04/2022)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (TOTAL), vide composição na capa.

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-0,11%	-0,44%	6,72%	8,83%	15,10%	0,48% (03/10/2022)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,39%	1,78%	10,56%	17,24%	25,39%	0,48% (03/10/2022)	-0,33% (05/05/2022)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,04% (08/03/2022)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)



DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA TOTAL (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: -  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (TOTAL)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,41578  
 PATRIMÔNIO: 140.702.084,02

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (TOTAL)

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	93,46%	IBX	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	5,82%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,71%

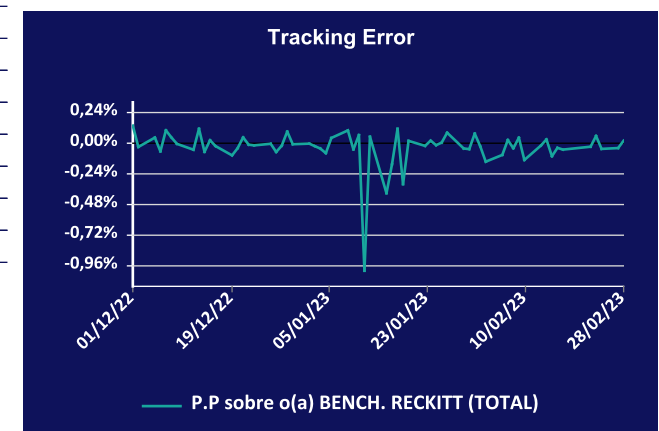
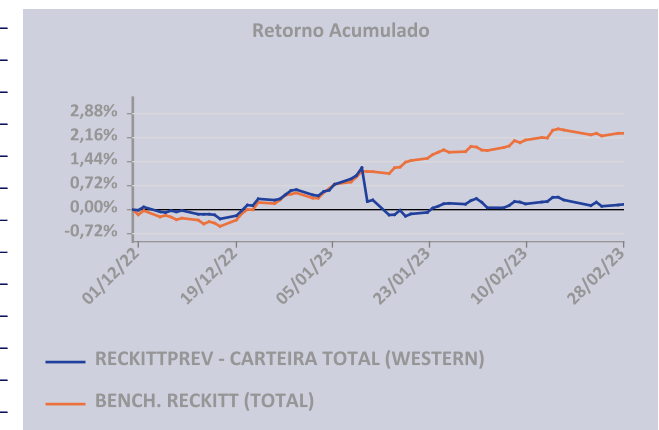
ESTILO: 29,37% | SELEÇÃO: 70,63%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0480%	--
RETORNO ACUMULADO	0,1596%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,2895%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,1298%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0424%	--
BETA	0,0635	--
MARKET TIMING	0,2749	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,2134	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	87,8941%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9766%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	18,2593%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-3,5140	--
JENSEN	-2,4091%	--
MODIGLIANI	-12,3336%	--
SHARPE	-0,2798	--
SORTINO	-0,2832	--
TREYNOR	-0,0076	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	26,2940	--
DOWNSIDE RISK	0,1696%	--
RISCO ATIVO	0,1529%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,4273%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1524%	--
RISCO TOTAL	0,1717%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,7271%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	2
MAIOR RETORNO MENSAL	0,6001%(12/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	-0,3254%(01/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (TOTAL), vide composição na capa.

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-0,11%	-0,44%	6,72%	8,83%	15,10%	0,23% (11/01/2023)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,39%	1,78%	10,56%	17,24%	25,39%	0,22% (15/02/2023)	-0,19% (05/12/2022)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	2,19% (05/01/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	2,12% (05/01/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	2,63% (20/12/2022)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	3,29% (20/12/2022)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	2,12% (17/01/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,49% (20/12/2022)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,31% (12/12/2022)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-1,18% (20/01/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)

DADOS CADASTRAIS

CNPJ: N/A  
 CÓD. ANBIMA: N/A  
 NOME FANTASIA: RECKITTPREV - CARTEIRA TOTAL (WESTERN)  
 GESTOR: WESTERN ASSET  
 ADMINISTRADOR: -  
 CLASSIFICAÇÃO: -  
 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO: 0,35%  
 BENCHMARK: BENCH. RECKITT (TOTAL)

SITUAÇÃO

ÚLTIMA COTA: 2,41578  
 PATRIMÔNIO: 140.702.084,02

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

AGRUPAMENTO PPS: -  
 ATIVO LIVRE DE RISCO: CDI  
 APURAÇÃO DA COTA: LÍQUIDO  
 ÍNDICE DE REFERÊNCIA: BENCH. RECKITT (TOTAL)

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	76,22%	IBX	3,45%
IVBX-2	0,18%	SMLL	0,63%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	19,53%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 61,30%

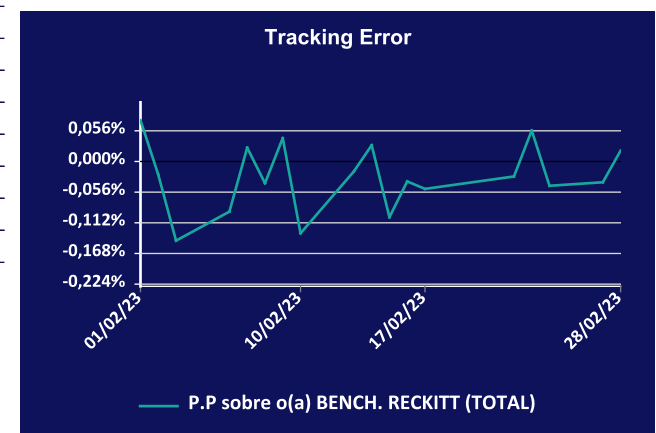
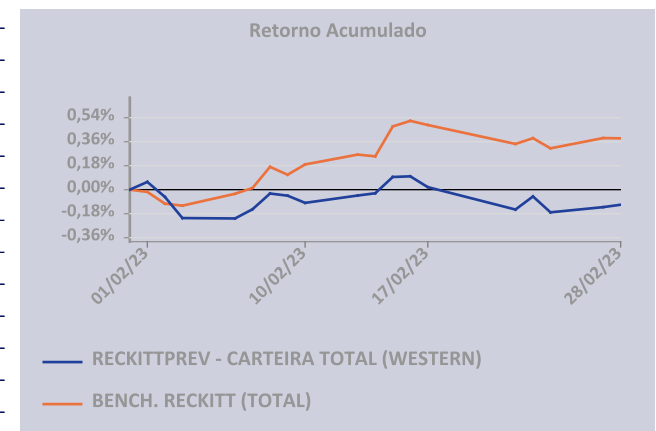
SELEÇÃO: 38,70%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0570%	--
RETORNO ACUMULADO	-0,1127%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,3859%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,4986%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0185%	--
BETA	0,0580	--
MARKET TIMING	-0,7373	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5712	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	58,8368%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,8824%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	45,5760%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-7,0412	--
JENSEN	-0,5122%	--
MODIGLIANI	-4,1492%	--
SHARPE	-0,6244	--
SORTINO	-0,5580	--
TREYNOR	-0,0093	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,0535	--
DOWNSIDE RISK	0,1021%	--
RISCO ATIVO	0,0623%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	0,9901%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,0605%	--
RISCO TOTAL	0,0913%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,4494%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	0
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (TOTAL)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	-0,1128%(02/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-0,1128%(02/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com:  
 BENCH. RECKITT (TOTAL), vide composição na capa.

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	-0,11%	-0,44%	6,72%	8,83%	15,10%	0,12% (15/02/2023)	-0,17% (22/02/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	0,39%	1,78%	10,56%	17,24%	25,39%	0,22% (15/02/2023)	-0,14% (22/02/2023)
CDI	0,92%	2,05%	13,01%	19,43%	22,25%	0,05% (10/02/2023)	0,05% (02/02/2023)
IBOVESPA	-7,49%	-4,38%	-7,26%	-4,64%	0,73%	1,97% (08/02/2023)	-1,85% (22/02/2023)
IBX	-7,59%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	1,84% (08/02/2023)	-1,87% (02/02/2023)
IVBX-2	-8,11%	-5,10%	-17,74%	-24,44%	-24,52%	1,81% (15/02/2023)	-2,56% (09/02/2023)
SMLL	-10,52%	-7,90%	-20,21%	-30,84%	-29,32%	1,94% (15/02/2023)	-2,72% (09/02/2023)
IDIV	-7,55%	-2,11%	5,04%	14,70%	10,65%	1,44% (08/02/2023)	-2,44% (09/02/2023)
IRF-M	0,86%	1,71%	10,13%	10,66%	13,99%	0,46% (15/02/2023)	-0,38% (03/02/2023)
IMA B 5	1,41%	2,82%	11,57%	18,62%	26,01%	0,36% (15/02/2023)	-0,16% (03/02/2023)
IMA B 5+	1,17%	-0,11%	4,86%	0,42%	1,37%	1,17% (15/02/2023)	-0,77% (03/02/2023)
DÓLAR PTAX	2,13%	-0,19%	1,33%	-5,83%	15,76%	2,26% (03/02/2023)	-1,62% (02/02/2023)