

pps *portfolio
performance*

Avaliação de Performance: RECKITT PREV

Janeiro/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 12,71%, figurou bem acima da variação da meta utilizada nesta análise, de 11,00%, que corresponde ao INPC acrescido de 5,00% ao ano.

- **CARTEIRA RENDA FIXA (WESTERN):** O desempenho mensal percebido por este investimento foi extremamente prejudicado pela exposição nas debêntures das Lojas Americanas, empresa do setor varejista brasileiro que, no início deste ano, surpreendeu o mercado ao anunciar um rombo contábil bilionário. Por conta disso, temos um rendimento negativo, queda da ordem de 1,3%. O risco total se mostrou elevado e os índices de Sharpe e de Sortino, medidas de retorno ajustado por risco, decepcionaram. O histórico dos últimos doze meses, bem como o construído em períodos mais longos, também deixou a desejar. 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):** Em mais uma ocasião, o desempenho mensal fornecido pela Western no segmento de renda variável não agradou. O retorno acumulado, inferior ao “benchmark” proposto, figurou na última posição do ranking elaborado pela PPS. O risco total e o risco diversificável se mostraram elevados; contrapondo-se ao beta. Os índices de Jensen e de Modigliani, medidas de retorno ajustado por risco, foram negativos e modestos. Em janeiro, há indícios de sucesso na seleção dos ativos, alfa obtido com baixa significância estatística, e de insucesso 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 também desagradou. 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. Por outro lado, o desempenho mensal foi bastante positivo. 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: Em janeiro, a diversificação funcionou, mas não impediu a queda da carteira consolidada que desvalorizou cerca de 0,3%, graças aos impactos associados a exposição em debêntures das Lojas Americanas. Obviamente, o “benchmark” proposto, que rendeu 1,4%, não foi atendido. O histórico dos últimos doze meses, que já não vinha bem, piorou. 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 – JANEIRO DE 2023

Descrição	Patrimônio (R\$)	%
Renda Fixa (Passiva)	28.397.806,08	16,76%
Renda Fixa (Ativa)	107.713.465,70	63,56%
Renda Variável	7.982.427,07	4,71%
Estruturado	15.717.027,88	9,27%
Exterior	9.660.498,67	5,70%
Total	169.471.225,40	100,00%

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: -.-
RENDA FIXA (Títulos na Curva)*

Janeiro/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: 5,07687
 PATRIMÔNIO: 28.397.806,08

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	96,39%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	2,93%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,41%	DÓLAR PTAX	0,27%

ESTILO: 2,69%

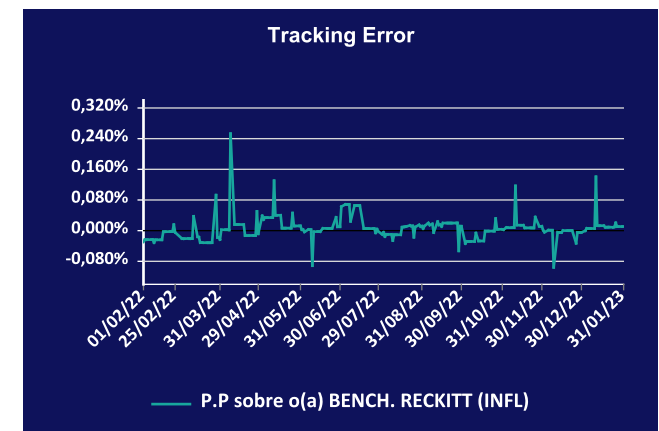
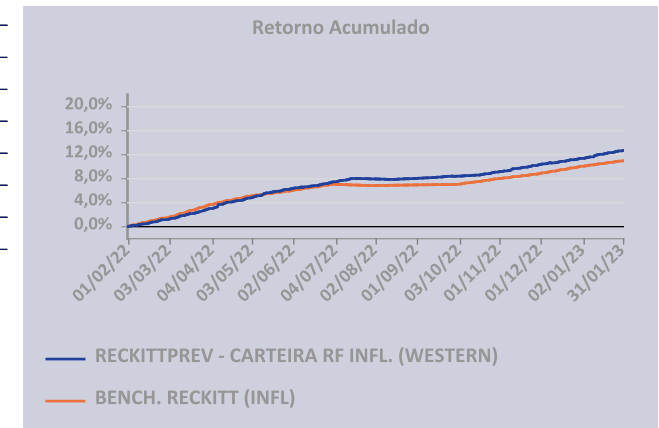
SELEÇÃO: 97,31%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0004%	--
RETORNO ACUMULADO	12,7116%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,9969%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	1,7146%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0104	--
SORTINO	-0,0165	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	20,1400	--
DOWNSIDE RISK	0,0242%	--
RISCO ATIVO	0,0313%	--
RISCO TOTAL	0,0365%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,5807%	--

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)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	1,21%	1,21%	12,71%	30,85%	44,01%	0,33% (08/04/2022)	-0,05% (28/09/2022)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,87%	0,87%	11,00%	28,90%	42,83%	0,10% (02/03/2022)	-0,01% (05/07/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,03% (02/02/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,15%	1,15%	13,10%	19,09%	21,75%	0,07% (21/02/2022)	0,01% (20/04/2022)
IMA-B	-0,00%	-0,00%	7,15%	5,93%	11,46%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,53%	0,53%	5,77%	16,75%	22,08%	0,07% (02/03/2022)	-0,03% (11/07/2022)
INPC	0,46%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	0,08% (02/03/2022)	-0,03% (08/07/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)

COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

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: 5,07687
 PATRIMÔNIO: 28.397.806,08

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	99,93%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,06%

ESTILO: 0,08%

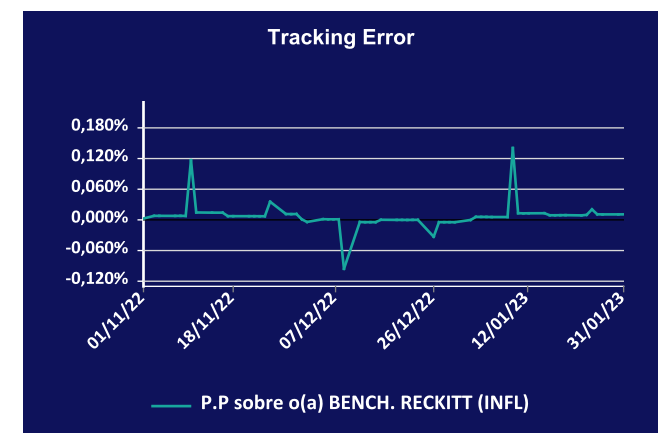
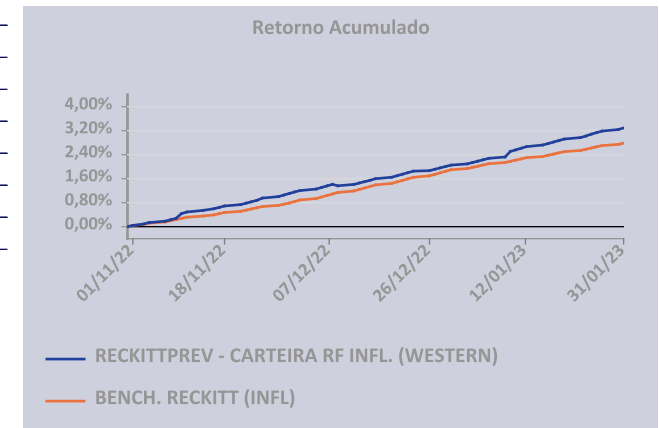
SELEÇÃO: 99,92%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0001%	--
RETORNO ACUMULADO	3,2901%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,7836%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,5064%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	-0,0076	--
SORTINO	-0,0143	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	17,3720	--
DOWNSIDE RISK	0,0133%	--
RISCO ATIVO	0,0267%	--
RISCO TOTAL	0,0251%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,3990%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	3
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (INFL)	2
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (INFL)	1
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	1,21%	1,21%	12,71%	30,85%	44,01%	0,18% (10/01/2023)	-0,05% (09/12/2022)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,87%	0,87%	11,00%	28,90%	42,83%	0,05% (01/12/2022)	0,04% (01/11/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (18/11/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,15%	1,15%	13,10%	19,09%	21,75%	0,06% (04/01/2023)	0,05% (19/12/2022)
IMA-B	-0,00%	-0,00%	7,15%	5,93%	11,46%	1,14% (29/11/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,46% (29/11/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,75% (29/11/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,53%	0,53%	5,77%	16,75%	22,08%	0,03% (01/12/2022)	0,02% (01/11/2022)
INPC	0,46%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	0,03% (01/12/2022)	0,02% (01/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,78% (10/11/2022)	-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: 5,07687
 PATRIMÔNIO: 28.397.806,08

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	IRF-M	0,00%
	91,53%		
	8,47%	IMA B 5+	0,00%
	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 20,74%

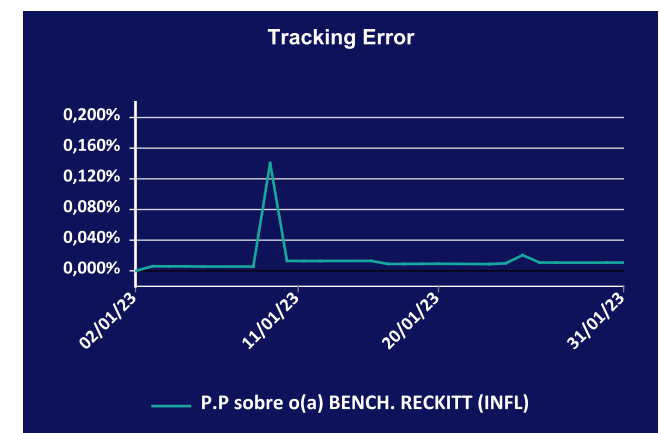
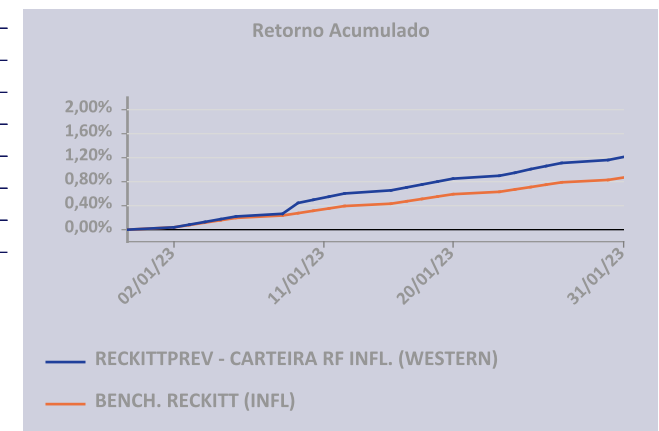
SELEÇÃO: 79,26%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,0040%	--
RETORNO ACUMULADO	1,2124%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,8692%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	0,3431%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
SHARPE	0,1420	--
SORTINO	1,0389	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	17,5396	--
DOWNSIDE RISK	0,0038%	--
RISCO ATIVO	0,0282%	--
RISCO TOTAL	0,0282%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,4482%	--

PERFIL DE RETORNOS

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



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	1,21%	1,21%	12,71%	30,85%	44,01%	0,18% (10/01/2023)	0,04% (02/01/2023)
BENCH. RECKITT (INFL)	0,87%	0,87%	11,00%	28,90%	42,83%	0,04% (02/01/2023)	0,04% (02/01/2023)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (24/01/2023)	0,05% (18/01/2023)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,39% (05/01/2023)	-0,36% (16/01/2023)
IMA-S	1,15%	1,15%	13,10%	19,09%	21,75%	0,06% (04/01/2023)	0,05% (12/01/2023)
IMA-B	-0,00%	-0,00%	7,15%	5,93%	11,46%	0,70% (11/01/2023)	-0,67% (02/01/2023)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,35% (10/01/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,10% (11/01/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,31% (11/01/2023)	-0,26% (02/01/2023)
IPCA	0,53%	0,53%	5,77%	16,75%	22,08%	0,02% (02/01/2023)	0,02% (02/01/2023)
INPC	0,46%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	0,02% (02/01/2023)	0,02% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)



Agrupamento: Renda Fixa
ÍNDICES (PPS)

Janeiro/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: 2,86757
 PATRIMÔNIO: 107.713.465,70

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	74,96%	IRF-M	12,56%
IMA B 5	10,62%	IMA B 5+	1,06%
IMA-C	0,41%	DÓLAR PTAX	0,38%

ESTILO: 18,49%

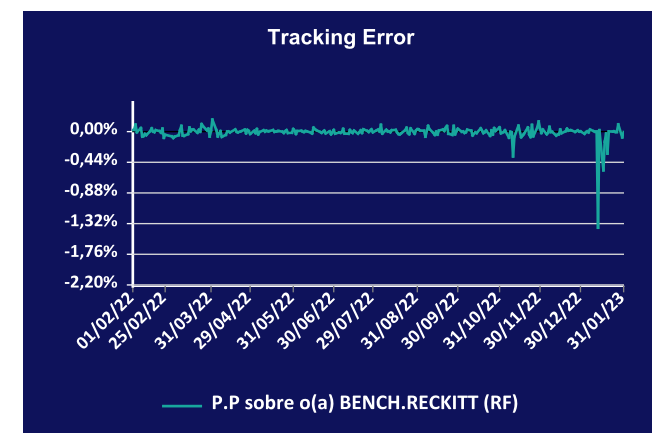
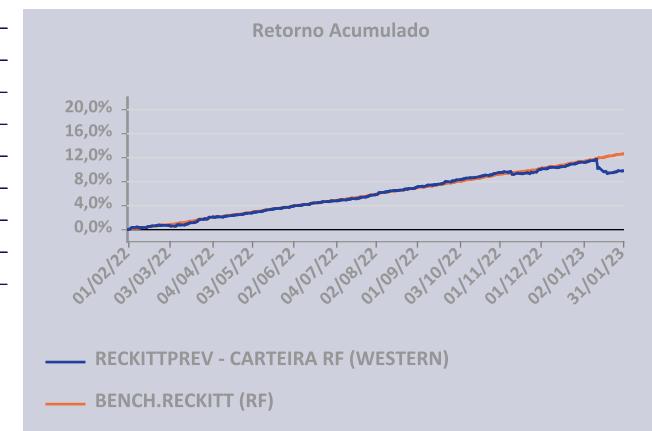
SELEÇÃO: 81,51%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0106%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	9,8309%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	12,6660%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,8350%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,5048	9° de 15
SHARPE	-0,0954	12° de 15
SORTINO	-0,1015	12° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	113,4726	--
DOWNSIDE RISK	0,1046%	3° de 15
RISCO ATIVO	0,1060%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,1110%	5° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,7631%	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	-1,27%	-1,27%	9,83%	12,89%	17,05%	0,25% (01/04/2022)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,15%	1,15%	12,67%	19,89%	23,86%	0,10% (04/08/2022)	-0,01% (10/11/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,03% (02/02/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,15%	1,15%	13,10%	19,09%	21,75%	0,07% (21/02/2022)	0,01% (20/04/2022)
IMA-B	-0,00%	-0,00%	7,15%	5,93%	11,46%	1,24% (04/08/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,53%	0,53%	5,77%	16,75%	22,08%	0,07% (02/03/2022)	-0,03% (06/07/2022)
INPC	0,46%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	0,08% (02/03/2022)	-0,03% (11/07/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	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: 2,86757
 PATRIMÔNIO: 107.713.465,70

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	80,32%	IRF-M	18,50%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,58%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,59%

ESTILO: 8,36%

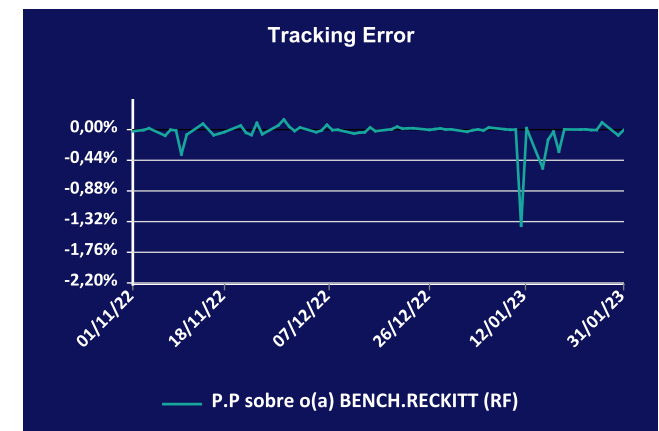
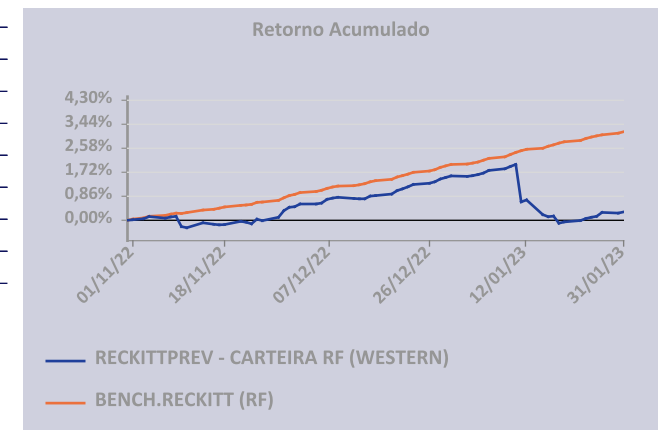
SELEÇÃO: 91,64%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0458%	13° de 15
RETORNO ACUMULADO	0,3007%	13° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,1739%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,8731%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-3,5338	10° de 15
SHARPE	-0,2280	12° de 15
SORTINO	-0,2287	11° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	33,5388	--
DOWNSIDE RISK	0,2006%	2° de 15
RISCO ATIVO	0,1973%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,2012%	3° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	3,1944%	3° 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	-1,27%	-1,27%	9,83%	12,89%	17,05%	0,24% (29/11/2022)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,15%	1,15%	12,67%	19,89%	23,86%	0,09% (29/11/2022)	-0,01% (10/11/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (18/11/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA-S	1,15%	1,15%	13,10%	19,09%	21,75%	0,06% (04/01/2023)	0,05% (19/12/2022)
IMA-B	-0,00%	-0,00%	7,15%	5,93%	11,46%	1,14% (29/11/2022)	-1,47% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,46% (29/11/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,75% (29/11/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
IPCA	0,53%	0,53%	5,77%	16,75%	22,08%	0,03% (01/12/2022)	0,02% (01/11/2022)
INPC	0,46%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	0,03% (01/12/2022)	0,02% (01/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,78% (10/11/2022)	-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: 2,86757
 PATRIMÔNIO: 107.713.465,70

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	82,97%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	15,12%	DÓLAR PTAX	1,90%

ESTILO: 0,70%

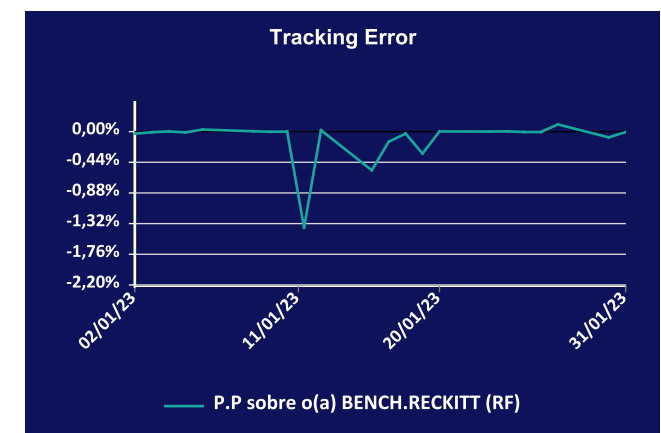
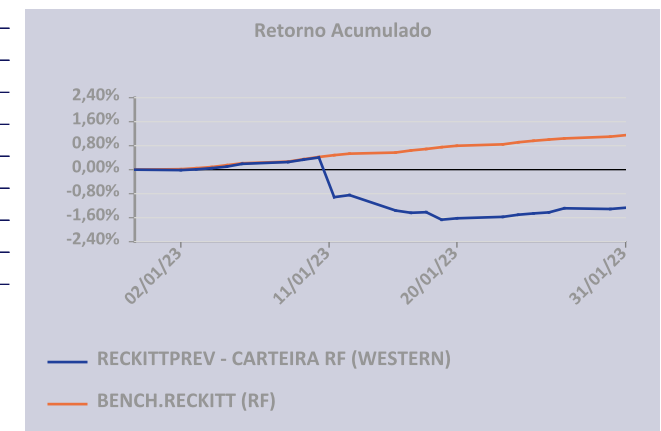
SELEÇÃO: 99,30%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1083%	14° de 15
RETORNO ACUMULADO	-1,2682%	14° de 15
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,1508%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,4190%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-5,5180	12° de 15
SHARPE	-0,3450	12° de 15
SORTINO	-0,3338	12° de 15
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	12,1590	--
DOWNSIDE RISK	0,3244%	2° de 15
RISCO ATIVO	0,3151%	1° de 15
RISCO TOTAL	0,3139%	2° de 15
RISCO TOTAL ANUALIZADO	4,9833%	2° de 15

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	0
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH.RECKITT (RF)	0
MESES ABAIXO DO BENCH.RECKITT (RF)	1
MAIOR RETORNO MENSAL	-1,2682%(01/2023)
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	-1,27%	-1,27%	9,83%	12,89%	17,05%	0,14% (27/01/2023)	-1,32% (12/01/2023)
BENCH.RECKITT (RF)	1,15%	1,15%	12,67%	19,89%	23,86%	0,08% (10/01/2023)	0,02% (02/01/2023)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (24/01/2023)	0,05% (18/01/2023)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,39% (05/01/2023)	-0,36% (16/01/2023)
IMA-S	1,15%	1,15%	13,10%	19,09%	21,75%	0,06% (04/01/2023)	0,05% (12/01/2023)
IMA-B	-0,00%	-0,00%	7,15%	5,93%	11,46%	0,70% (11/01/2023)	-0,67% (02/01/2023)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,35% (10/01/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,10% (11/01/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,31% (11/01/2023)	-0,26% (02/01/2023)
IPCA	0,53%	0,53%	5,77%	16,75%	22,08%	0,02% (02/01/2023)	0,02% (02/01/2023)
INPC	0,46%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	0,02% (02/01/2023)	0,02% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2022 A 31/01/2023
 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 - ITAÚ	0,5979	11,3408%	-0,0439	1,8735%	0,38%	311.487.259,99	252
2	CLIENTE V - SANTANDER	0,2121	12,7888%	-0,0065	0,3254%	0,20%	615.176.981,32	252
3	CLIENTE M - BAHIA	0,1951	12,9546%	0,0058	1,3082%	0,77%	91.750.921,58	252
4	CLIENTE X - ITAU	-0,0845	12,8028%	-0,0007	1,2896%	0,13%	1.048.540.676,84	252
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-0,1223	12,6721%	-0,0052	1,5238%	0,10%	724.124.070,21	252
6	CLIENTE Y - BNP	-0,2478	12,1507%	-0,0272	1,3619%	0,16%	265.963.106,34	252
7	CLIENTE V - BRADESCO	-0,5948	10,4278%	-0,0588	2,2744%	0,34%	259.045.214,21	252
8	CLIENTE D - WESTERN	-1,0247	9,9269%	-0,0847	1,9183%	0,00%	243.791.873,47	252
9	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-1,5049	9,8309%	-0,0955	1,7631%	0,35%	107.713.465,70	252
10	CLIENTE V - WESTERN	-1,7388	8,0832%	-0,1070	2,5073%	0,38%	252.443.334,69	252
11	CLIENTE X - BRADESCO	-2,0131	13,0209%	0,0265	0,4127%	0,13%	930.654.943,52	252
12	CLIENTE X - WESTERN	-2,0769	11,6450%	-0,0723	0,9136%	0,10%	948.095.209,85	252
13	CLIENTE Y - WESTERN	-2,2746	10,9802%	-0,0967	1,0682%	0,10%	262.198.276,56	252
14	CLIENTE O - SANTANDER	-3,9278	11,4155%	-0,1203	0,6580%	0,18%	354.793.470,23	252
15	CLIENTE O - BRADESCO	-4,9533	12,5916%	-0,0324	0,4094%	0,18%	331.893.489,52	252
	MÉDIA:	-1,3039	11,5088%	-0,0479	1,3072%		449.844.819,60	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2022 A 31/01/2023
 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	-1,1230	1,5789%	-0,1212	3,4164%	0,34%	259.045.214,21	64
2	CLIENTE M - BAHIA	-1,2609	2,4942%	-0,0935	2,0726%	0,77%	91.750.921,58	64
3	CLIENTE Y - BNP	-2,1280	2,5094%	-0,1209	1,5761%	0,16%	265.963.106,34	64
4	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-2,1837	2,5297%	-0,1038	1,7865%	0,10%	724.124.070,21	64
5	CLIENTE V - SANTANDER	-2,5162	2,9268%	-0,1698	0,5327%	0,20%	615.176.981,32	64
6	CLIENTE V - ITAÚ	-2,5333	1,7976%	-0,1577	2,2997%	0,38%	311.487.259,99	64
7	CLIENTE D - WESTERN	-3,0151	0,2477%	-0,2417	3,0691%	0,00%	243.791.873,47	64
8	CLIENTE X - ITAU	-3,3776	2,5789%	-0,1254	1,3871%	0,13%	1.048.540.676,84	64
9	CLIENTE X - BRADESCO	-3,4208	3,2581%	-0,0187	0,5725%	0,13%	930.654.943,52	64
10	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-3,5338	0,3008%	-0,2281	3,1944%	0,35%	107.713.465,70	64
11	CLIENTE V - WESTERN	-3,6267	-0,8202%	-0,2584	3,8919%	0,38%	252.443.334,69	64
12	CLIENTE Y - WESTERN	-3,7797	2,0641%	-0,2087	1,4315%	0,10%	262.198.276,56	64
13	CLIENTE X - WESTERN	-3,9500	1,9561%	-0,2081	1,5612%	0,10%	948.095.209,85	64
14	CLIENTE O - SANTANDER	-4,7889	2,0584%	-0,2488	1,2072%	0,18%	354.793.470,23	64
15	CLIENTE O - BRADESCO	-4,9064	3,0718%	-0,0863	0,6425%	0,18%	331.893.489,52	64
	MÉDIA:	-3,0763	1,9035%	-0,1594	1,9094%		449.844.819,60	

INFORMATION RATIO ANUALIZADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/01/2023
 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	-0,0117	1,0567%	-0,0332	1,4161%	0,77%	91.750.921,58	22
2	CLIENTE V - BRADESCO	-0,1138	0,7766%	-0,0913	2,6913%	0,34%	259.045.214,21	22
3	CLIENTE V - ITAÚ	-0,4650	0,7842%	-0,1272	1,8970%	0,38%	311.487.259,99	22
4	CLIENTE O - BRADESCO	-0,6581	1,2133%	0,0807	0,7982%	0,18%	331.893.489,52	22
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	-0,9203	1,2190%	0,0650	1,0562%	0,10%	724.124.070,21	22
6	CLIENTE Y - BNP	-1,1082	1,1487%	0,0147	1,2631%	0,16%	265.963.106,34	22
7	CLIENTE X - ITAU	-2,2161	1,1656%	0,0305	0,9996%	0,13%	1.048.540.676,84	22
8	CLIENTE X - BRADESCO	-4,9250	1,1428%	0,0172	0,8198%	0,13%	930.654.943,52	22
9	CLIENTE V - SANTANDER	-5,1138	0,8357%	-0,2986	0,6880%	0,20%	615.176.981,32	22
10	CLIENTE D - WESTERN	-5,4695	-1,1749%	-0,3713	4,4515%	0,00%	243.791.873,47	22
11	CLIENTE X - WESTERN	-5,4743	0,2601%	-0,3006	2,0542%	0,10%	948.095.209,85	22
12	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-5,5181	-1,2682%	-0,3450	4,9834%	0,35%	107.713.465,70	22
13	CLIENTE V - WESTERN	-5,6490	-1,6556%	-0,3882	5,1577%	0,38%	252.443.334,69	22
14	CLIENTE Y - WESTERN	-5,8203	0,5468%	-0,2882	1,4299%	0,10%	262.198.276,56	22
15	CLIENTE O - SANTANDER	-6,2369	0,1347%	-0,3861	1,8339%	0,18%	354.793.470,23	22
	MÉDIA:	-3,3133	0,4124%	-0,1615	2,1027%		449.844.819,60	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2022 A 31/01/2023
 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	13,0209%	0,0265	0,0007%	0,4127%	0,13%	930.654.943,52	252
2	CLIENTE M - BAHIA	12,9546%	0,0058	0,0005%	1,3082%	0,77%	91.750.921,58	252
3	CLIENTE X - ITAU	12,8028%	-0,0007	-0,0001%	1,2896%	0,13%	1.048.540.676,84	252
4	CLIENTE V - SANTANDER	12,7888%	-0,0065	-0,0001%	0,3254%	0,20%	615.176.981,32	252
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	12,6721%	-0,0052	-0,0005%	1,5238%	0,10%	724.124.070,21	252
6	CLIENTE O - BRADESCO	12,5916%	-0,0324	-0,0008%	0,4094%	0,18%	331.893.489,52	252
7	CLIENTE Y - BNP	12,1507%	-0,0272	-0,0024%	1,3619%	0,16%	265.963.106,34	252
8	CLIENTE X - WESTERN	11,6450%	-0,0723	-0,0042%	0,9136%	0,10%	948.095.209,85	252
9	CLIENTE O - SANTANDER	11,4155%	-0,1203	-0,0050%	0,6580%	0,18%	354.793.470,23	252
10	CLIENTE V - ITAÚ	11,3408%	-0,0439	-0,0052%	1,8735%	0,38%	311.487.259,99	252
11	CLIENTE Y - WESTERN	10,9802%	-0,0967	-0,0065%	1,0682%	0,10%	262.198.276,56	252
12	CLIENTE V - BRADESCO	10,4278%	-0,0588	-0,0084%	2,2744%	0,34%	259.045.214,21	252
13	CLIENTE D - WESTERN	9,9269%	-0,0847	-0,0103%	1,9183%	0,00%	243.791.873,47	252
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	9,8309%	-0,0955	-0,0106%	1,7631%	0,35%	107.713.465,70	252
15	CLIENTE V - WESTERN	8,0832%	-0,1070	-0,0169%	2,5073%	0,38%	252.443.334,69	252
	MÉDIA:	11,5088%	-0,0479	-0,0047%	1,3072%		449.844.819,60	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2022 A 31/01/2023
 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

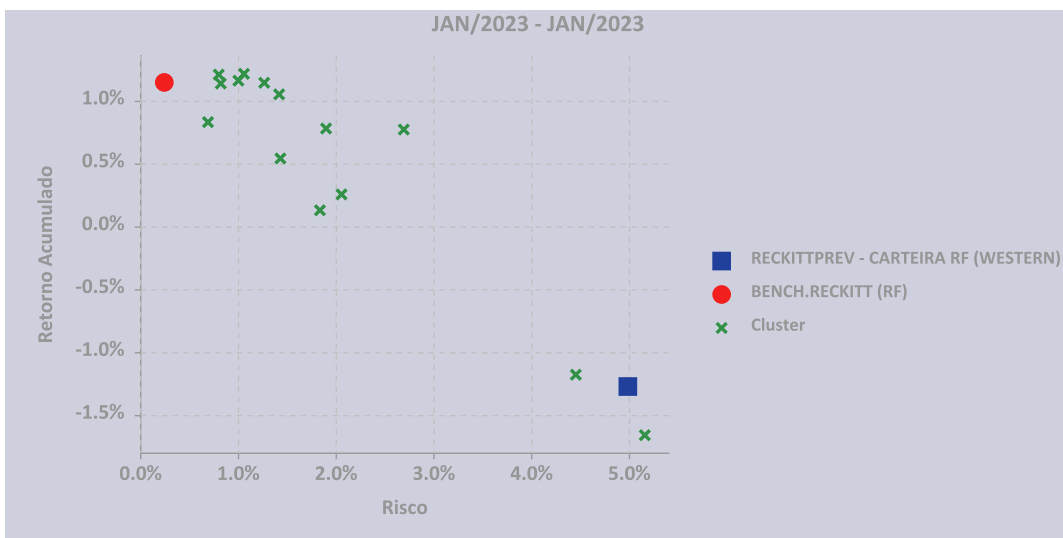
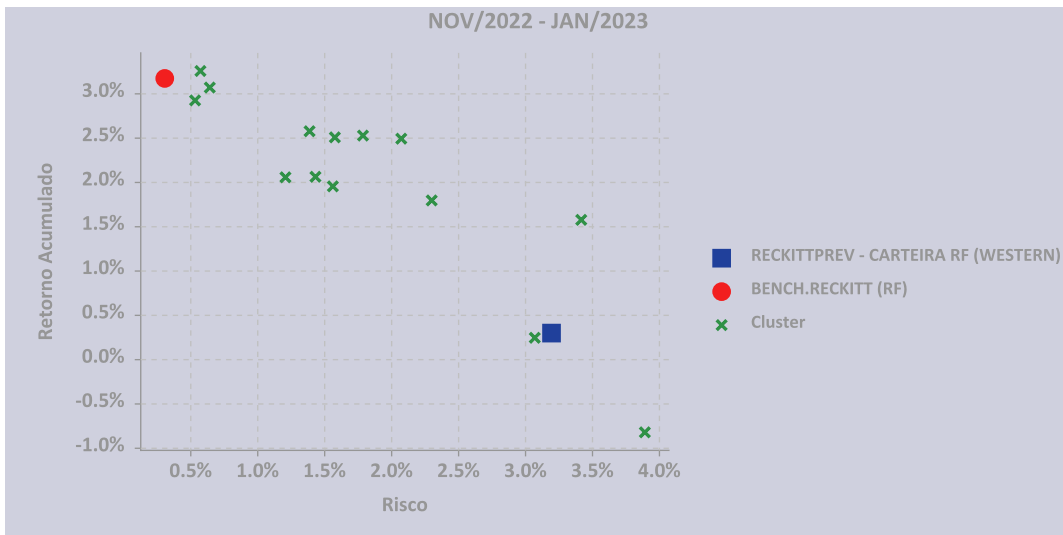
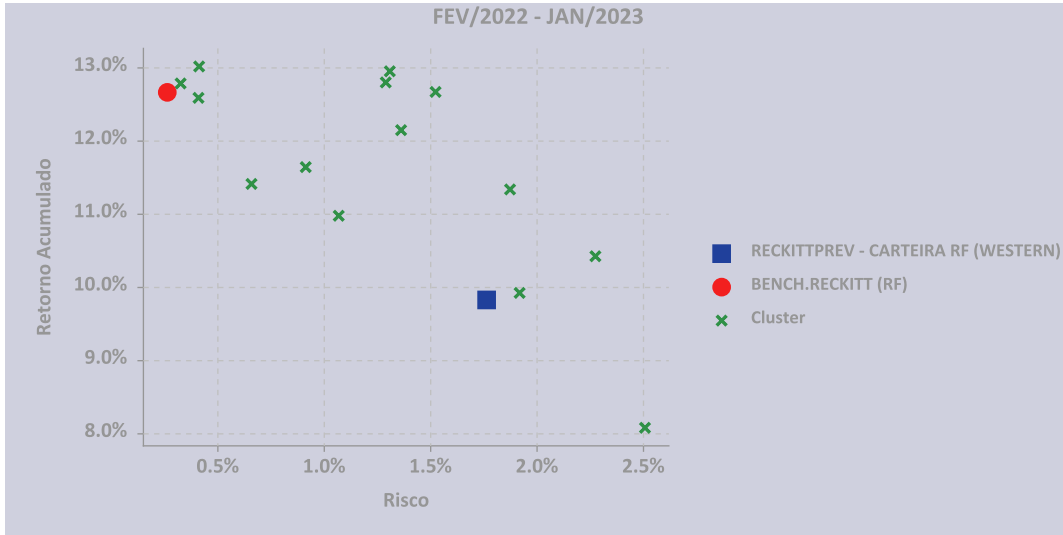
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	SHARPE	PRÊMIO MÉDIO	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	CLIENTE X - BRADESCO	3,2581%	-0,0187	-0,0007%	0,5725%	0,13%	930.654.943,52	64
2	CLIENTE O - BRADESCO	3,0718%	-0,0863	-0,0035%	0,6425%	0,18%	331.893.489,52	64
3	CLIENTE V - SANTANDER	2,9268%	-0,1698	-0,0057%	0,5327%	0,20%	615.176.981,32	64
4	CLIENTE X - ITAU	2,5789%	-0,1254	-0,0110%	1,3871%	0,13%	1.048.540.676,84	64
5	CLIENTE X - BNP PARIBAS	2,5297%	-0,1038	-0,0117%	1,7865%	0,10%	724.124.070,21	64
6	CLIENTE Y - BNP	2,5094%	-0,1209	-0,0120%	1,5761%	0,16%	265.963.106,34	64
7	CLIENTE M - BAHIA	2,4942%	-0,0935	-0,0122%	2,0726%	0,77%	91.750.921,58	64
8	CLIENTE Y - WESTERN	2,0641%	-0,2087	-0,0188%	1,4315%	0,10%	262.198.276,56	64
9	CLIENTE O - SANTANDER	2,0584%	-0,2488	-0,0189%	1,2072%	0,18%	354.793.470,23	64
10	CLIENTE X - WESTERN	1,9561%	-0,2081	-0,0205%	1,5612%	0,10%	948.095.209,85	64
11	CLIENTE V - ITAÚ	1,7976%	-0,1577	-0,0228%	2,2997%	0,38%	311.487.259,99	64
12	CLIENTE V - BRADESCO	1,5789%	-0,1212	-0,0261%	3,4164%	0,34%	259.045.214,21	64
13	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	0,3008%	-0,2281	-0,0459%	3,1944%	0,35%	107.713.465,70	64
14	CLIENTE D - WESTERN	0,2477%	-0,2417	-0,0467%	3,0691%	0,00%	243.791.873,47	64
15	CLIENTE V - WESTERN	-0,8202%	-0,2584	-0,0634%	3,8919%	0,38%	252.443.334,69	64
	MÉDIA:	1,9035%	-0,1594	-0,0213%	1,9094%		449.844.819,60	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/01/2023
 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 - BNP PARIBAS	1,2190%	0,0650	0,0043%	1,0562%	0,10%	724.124.070,21	22
2	CLIENTE O - BRADESCO	1,2133%	0,0807	0,0041%	0,7982%	0,18%	331.893.489,52	22
3	CLIENTE X - ITAU	1,1656%	0,0305	0,0019%	0,9996%	0,13%	1.048.540.676,84	22
4	CLIENTE Y - BNP	1,1487%	0,0147	0,0012%	1,2631%	0,16%	265.963.106,34	22
5	CLIENTE X - BRADESCO	1,1428%	0,0172	0,0009%	0,8198%	0,13%	930.654.943,52	22
6	CLIENTE M - BAHIA	1,0567%	-0,0332	-0,0030%	1,4161%	0,77%	91.750.921,58	22
7	CLIENTE V - SANTANDER	0,8357%	-0,2986	-0,0129%	0,6880%	0,20%	615.176.981,32	22
8	CLIENTE V - ITAÚ	0,7842%	-0,1272	-0,0152%	1,8970%	0,38%	311.487.259,99	22
9	CLIENTE V - BRADESCO	0,7766%	-0,0913	-0,0155%	2,6913%	0,34%	259.045.214,21	22
10	CLIENTE Y - WESTERN	0,5468%	-0,2882	-0,0260%	1,4299%	0,10%	262.198.276,56	22
11	CLIENTE X - WESTERN	0,2601%	-0,3006	-0,0389%	2,0542%	0,10%	948.095.209,85	22
12	CLIENTE O - SANTANDER	0,1347%	-0,3861	-0,0446%	1,8339%	0,18%	354.793.470,23	22
13	CLIENTE D - WESTERN	-1,1749%	-0,3713	-0,1041%	4,4515%	0,00%	243.791.873,47	22
14	RECKITTPREV - CARTEIRA RF (WESTERN)	-1,2682%	-0,3450	-0,1083%	4,9834%	0,35%	107.713.465,70	22
15	CLIENTE V - WESTERN	-1,6556%	-0,3882	-0,1261%	5,1577%	0,38%	252.443.334,69	22
	MÉDIA:	0,4124%	-0,1615	-0,0322%	2,1027%		449.844.819,60	

MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: Renda Variável
IBX*

Janeiro/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: 2,02288
 PATRIMÔNIO: 7.982.427,07

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

		IBX	
CDI	0,40%		89,68%
IVBX-2	7,22%	SMLL	0,90%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,27%
IMA-B	1,53%		

ESTILO: 98,97%

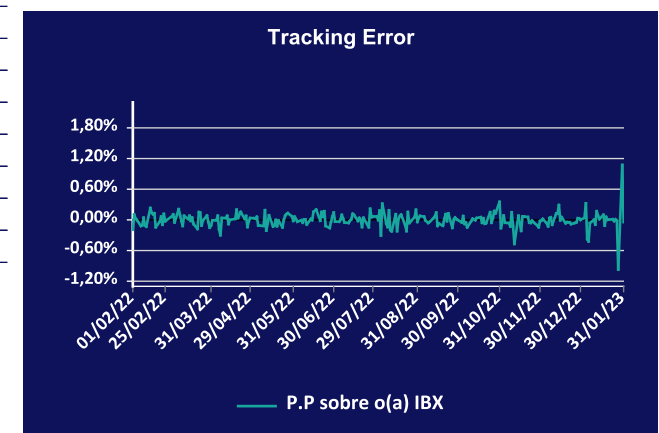
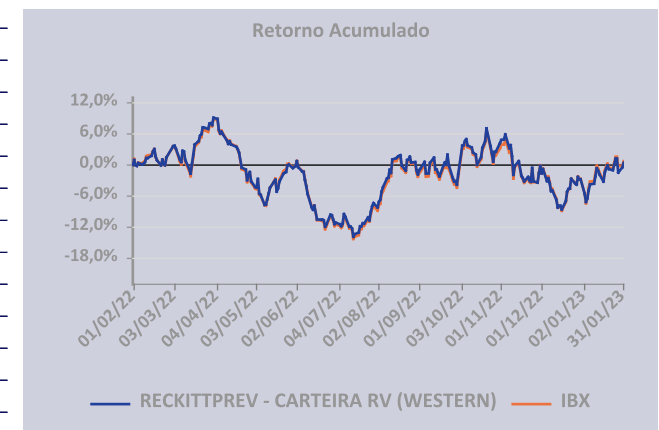
SELEÇÃO: 1,03%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0374%	29° de 33
RETORNO ACUMULADO	0,4373%	29° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	0,7504%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,3130%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0050%	13° de 33
BETA	0,9802	24° de 33
MARKET TIMING	-0,4025	28° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9879	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	35,8494%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	78,7470%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,1578	29° de 33
JENSEN	-0,5474%	29° de 33
MODIGLIANI	-0,4817%	29° de 33
SHARPE	-0,0282	29° de 33
SORTINO	-0,0382	29° de 33
TREYNOR	-0,0003	29° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	20,1591	--
DOWNSIDE RISK	0,9777%	14° de 33
RISCO ATIVO	0,1480%	9° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,3499%	9° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1457%	9° de 33
RISCO TOTAL	1,3257%	21° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	21,0460%	21° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	8
MESES NEGATIVOS	4
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	3,27%	3,27%	0,44%	-5,83%	-5,70%	5,54% (03/10/2022)	-3,53% (10/11/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,03% (02/02/2022)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	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: 2,02288
 PATRIMÔNIO: 7.982.427,07

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	91,36%
	IVBX-2	1,18%	SMLL	3,39%
	IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
	IMA-B	4,07%		

ESTILO: 96,82%

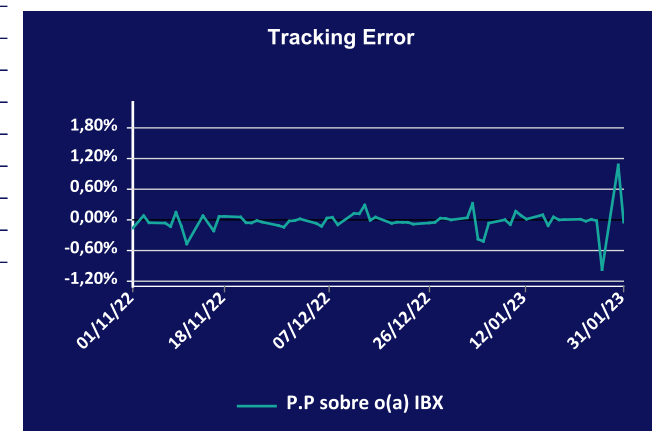
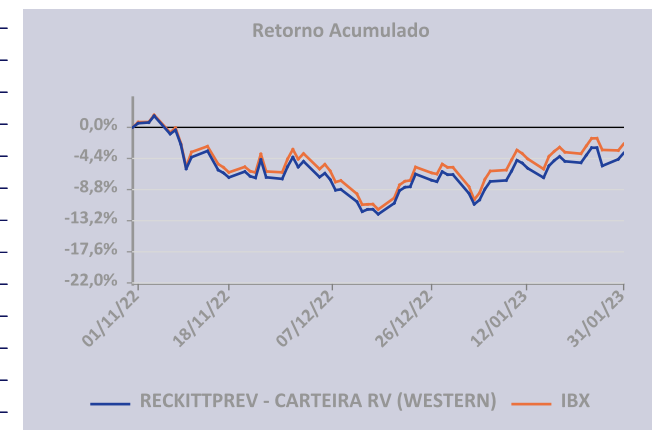
SELEÇÃO: 3,18%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0983%	32° de 33
RETORNO ACUMULADO	-3,6373%	32° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	-2,3383%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,2989%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0242%	6° de 33
BETA	0,9672	28° de 33
MARKET TIMING	-2,3006	30° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9775	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	49,2304%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	94,4578%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-1,4886	30° de 33
JENSEN	-1,4038%	32° de 33
MODIGLIANI	-1,3456%	32° de 33
SHARPE	-0,0682	32° de 33
SORTINO	-0,0863	30° de 33
TREYNOR	-0,0010	32° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	14,6141	--
DOWNSIDE RISK	1,1392%	4° de 33
RISCO ATIVO	0,2243%	6° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	3,5608%	6° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,2226%	6° de 33
RISCO TOTAL	1,4418%	15° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	22,8893%	15° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	2
MESES ACIMA DO IBX	1
MESES ABAIXO DO IBX	2
MAIOR RETORNO MENSAL	3,2669%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	-4,2214%(11/2022)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	3,27%	3,27%	0,44%	-5,83%	-5,70%	2,77% (24/11/2022)	-3,53% (10/11/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (18/11/2022)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	2,75% (24/11/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	2,78% (24/11/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	3,21% (24/11/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	3,52% (24/11/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	3,37% (11/11/2022)	-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: 2,02288
 PATRIMÔNIO: 7.982.427,07

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

		IBX	
CDI	0,00%		81,72%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,00%
IDIV	16,51%	IRF-M	0,00%
IMA-B	1,76%		

ESTILO: 91,55%

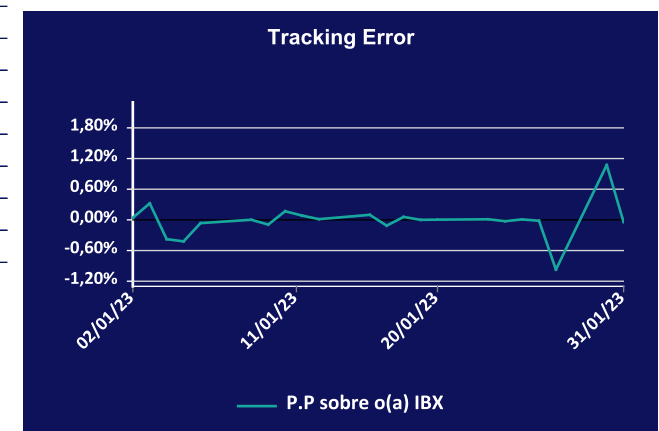
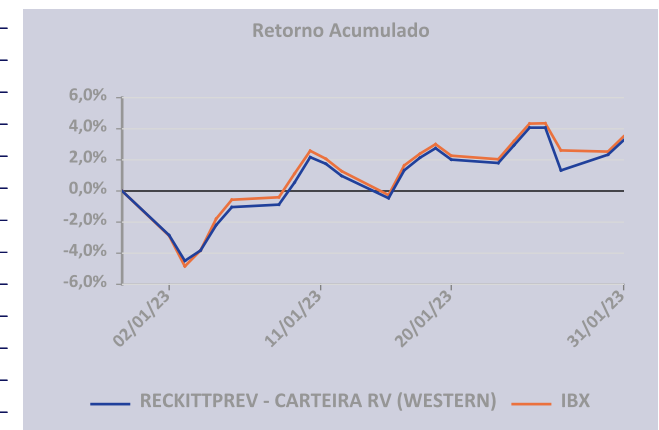
SELEÇÃO: 8,45%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,1042%	33° de 33
RETORNO ACUMULADO	3,2669%	33° de 33
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,5109%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,2440%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	0,0756%	4° de 33
BETA	0,9506	31° de 33
MARKET TIMING	-4,6376	32° de 33
R^2 DA REGRESSÃO	0,9376	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	51,5452%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9999%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	72,8231%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-0,4756	27° de 33
JENSEN	-0,1878%	31° de 33
MODIGLIANI	-0,2666%	31° de 33
SHARPE	0,0768	32° de 33
SORTINO	0,1034	32° de 33
TREYNOR	0,0010	31° de 33
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	6,8254	--
DOWNSIDE RISK	1,0086%	3° de 33
RISCO ATIVO	0,3517%	1° de 33
RISCO ATIVO ANUALIZADO	5,5837%	1° de 33
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,3503%	1° de 33
RISCO TOTAL	1,3579%	6° de 33
RISCO TOTAL ANUALIZADO	21,5569%	6° de 33

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO IBX	0
MESES ABAIXO DO IBX	1
MAIOR RETORNO MENSAL	3,2669%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	3,2669%(01/2023)



COMENTÁRIOS DO ANALISTA

Campos calculados com: IBX

QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	3,27%	3,27%	0,44%	-5,83%	-5,70%	1,80% (17/01/2023)	-2,84% (02/01/2023)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (24/01/2023)	0,05% (18/01/2023)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	2,19% (05/01/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	2,12% (05/01/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	2,09% (05/01/2023)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	3,06% (10/01/2023)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	2,12% (17/01/2023)	-2,39% (02/01/2023)

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE:	01/02/2022 A 31/01/2023
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	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	8,6373%	0,8823	9,7173%	19,2887%	0,41%	456.159.457,98	252
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	7,9906%	0,9289	8,9650%	20,1636%	0,75%	90.308.721,18	252
3	RPS FIC FI ACOES SELECTION	5,2725%	0,9850	5,8283%	21,9430%	1,70%	98.849.539,31	252
4	IAJA SAM ACOES FI	4,3140%	1,0079	4,9509%	21,6446%	0,22%	141.760.103,57	252
5	OCEANA VALOR FC FI ACOES	3,6122%	0,9230	4,7952%	20,2425%	2,00%	326.252.365,83	252
6	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	3,5464%	0,9368	4,6591%	20,4266%	2,00%	370.273.659,11	252
7	IAJA ACOES FC FIA	3,1023%	0,9945	3,8396%	21,3639%	0,08%	222.782.699,52	252
8	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	2,2805%	1,0246	2,7716%	21,8973%	0,70%	32.034.666,90	252
9	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	2,1214%	0,9878	2,9842%	21,0919%	0,00%	320.617.917,86	252
10	BRAM FIA IBRX ATIVO	2,1145%	0,9893	2,9626%	21,1233%	0,00%	387.105.145,94	252
11	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	2,0747%	0,9888	2,9273%	21,1148%	0,00%	134.672.219,33	252
12	BRADESCO FIA SALUBRE	1,3452%	0,9805	2,2943%	20,9379%	0,50%	137.570.409,64	252
13	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	1,2175%	0,9881	2,0865%	21,0997%	0,70%	10.928.347,12	252
14	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	1,2098%	0,9777	2,1980%	20,8658%	0,00%	210.596.633,36	252
15	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	1,1142%	0,9896	1,9691%	21,1294%	0,90%	201.348.396,87	252
16	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	0,7933%	0,9775	1,7895%	20,8680%	0,00%	95.305.847,19	252
17	MULTIPREV FIA	0,7891%	0,9760	1,7883%	20,8625%	0,00%	691.455.219,30	252
18	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,7624%	1,0059	1,4419%	21,4664%	0,00%	186.150.395,01	252
19	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,7257%	1,0006	1,4695%	21,3451%	0,00%	1.125.805.840,15	252
20	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,5664%	0,9838	1,5029%	20,9877%	0,16%	37.632.390,76	252
21	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,5475%	1,0000	1,2979%	21,3327%	0,15%	184.109.717,66	252
22	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,3464%	1,0003	1,0930%	21,3396%	0,30%	49.033.925,45	252
23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,3149%	0,9927	1,1509%	21,1775%	0,15%	140.306.027,86	252
24	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,3083%	0,9936	1,1343%	21,1957%	0,19%	46.565.545,51	252
25	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,1969%	0,9973	0,9791%	21,2756%	0,10%	513.667.267,76	252
26	COMSHELL CONCHA FIA	0,1413%	0,9846	1,0749%	21,0053%	0,17%	65.058.012,42	252
27	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-0,0503%	0,9988	0,7049%	21,3241%	0,56%	73.157.475,90	252
28	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,1311%	0,9660	1,0243%	20,6249%	0,75%	63.405.057,44	252
29	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,4817%	0,9803	0,4374%	21,0460%	0,35%	7.982.427,07	252
30	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,6824%	0,9964	0,1102%	21,2620%	0,09%	532.512.358,07	252
31	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,9706%	0,9948	-0,1572%	21,2297%	0,01%	532.794.842,98	252
32	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-1,8017%	0,9769	-0,8037%	20,9521%	0,15%	67.194.605,24	252
33	DAHLIA ACOES FC FIA	-2,8521%	0,9940	-2,9466%	22,5399%	1,85%	188.005.907,76	252
	MÉDIA:	1,4690%	0,9819	2,3043%	21,0960%		234.587.974,15	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2022 A 31/01/2023
 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	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,8229%	1,0164	-1,5972%	23,4344%	0,70%	32.034.666,90	64
2	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	0,7437%	0,8551	-1,0676%	20,5637%	0,41%	456.159.457,98	64
3	IAJA SAM ACOES FI	0,6303%	0,9996	-1,8015%	23,4732%	0,22%	141.760.103,57	64
4	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,5628%	0,9862	-1,7050%	22,7231%	0,56%	73.157.475,90	64
5	CITIPREVI INST FI EM ACOES	0,5351%	0,9751	-1,7032%	22,5914%	0,15%	67.194.605,24	64
6	BRAM FIA IBRX ATIVO	0,3276%	0,9843	-1,9371%	22,7234%	0,00%	387.105.145,94	64
7	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	0,3182%	1,0035	-2,0293%	23,0824%	0,00%	186.150.395,01	64
8	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,2967%	0,9996	-2,0401%	23,0363%	0,00%	1.125.805.840,15	64
9	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,2873%	0,9990	-2,0444%	23,0144%	0,15%	184.109.717,66	64
10	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	0,2559%	0,9850	-2,0118%	22,7407%	0,00%	134.672.219,33	64
11	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	0,2218%	0,9857	-2,0460%	22,7432%	0,00%	320.617.917,86	64
12	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,2049%	0,9993	-2,1304%	23,0301%	0,30%	49.033.925,45	64
13	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	0,1739%	0,9938	-2,1292%	22,8944%	0,15%	140.306.027,86	64
14	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,1734%	0,9979	-2,1547%	22,9996%	0,10%	513.667.267,76	64
15	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,1293%	0,9797	-2,1030%	22,5998%	0,16%	37.632.390,76	64
16	RPS FIC FI ACOES SELECTION	0,0977%	1,0304	-2,6324%	24,6716%	1,70%	98.849.539,31	64
17	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,0898%	0,9846	-2,1728%	22,7287%	0,90%	201.348.396,87	64
18	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0749%	0,9945	-2,2364%	22,9311%	0,19%	46.565.545,51	64
19	BRADESCO FIA SALUBRE	0,0312%	0,9752	-2,1818%	22,5279%	0,50%	137.570.409,64	64
20	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	0,0160%	0,9101	-2,0074%	21,7528%	0,75%	90.308.721,18	64
21	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-0,0408%	0,9857	-2,3027%	22,7334%	0,70%	10.928.347,12	64
22	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-0,0765%	0,9702	-2,2662%	22,4440%	0,00%	210.596.633,36	64
23	IAJA ACOES FC FIA	-0,1059%	0,9900	-2,5008%	23,2698%	0,08%	222.782.699,52	64
24	COMSHELL CONCHA FIA	-0,1076%	0,9831	-2,3624%	22,7081%	0,17%	65.058.012,42	64
25	MULTIPREV FIA	-0,1089%	0,9875	-2,3995%	22,8516%	0,00%	691.455.219,30	64
26	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-0,2320%	0,9710	-2,4321%	22,5005%	0,00%	95.305.847,19	64
27	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-0,3048%	0,9928	-2,6255%	22,9746%	0,09%	532.512.358,07	64
28	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,3234%	0,9923	-2,6406%	22,9614%	0,01%	532.794.842,98	64
29	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,4823%	0,9567	-2,5900%	22,1752%	0,75%	63.405.057,44	64
30	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-1,1850%	0,9588	-3,3343%	22,4048%	2,00%	326.252.365,83	64
31	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-1,3039%	0,9645	-3,4638%	22,4509%	2,00%	370.273.659,11	64
32	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-1,3456%	0,9673	-3,6373%	22,8894%	0,35%	7.982.427,07	64
33	DAHLIA ACOES FC FIA	-5,8551%	1,0515	-9,8890%	26,4418%	1,85%	188.005.907,76	64
	MÉDIA:	-0,1660%	0,9826	-2,4902%	22,8808%		234.587.974,15	

MODIGLIANI

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/01/2023
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	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	0,9030%	0,8824	4,1578%	19,6688%	0,41%	456.159.457,98	22
2	IAJA SAM ACOES FI	0,8630%	0,9911	4,4346%	21,7273%	0,22%	141.760.103,57	22
3	IAJA ACOES FC FIA	0,6941%	0,9823	4,2260%	21,4749%	0,08%	222.782.699,52	22
4	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,5629%	0,9947	4,0722%	21,3175%	0,70%	32.034.666,90	22
5	BRAM FIA IBRX ATIVO	0,2505%	0,9835	3,7235%	21,0224%	0,00%	387.105.145,94	22
6	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	0,2244%	0,9871	3,7060%	21,0900%	0,00%	134.672.219,33	22
7	CITIPREVI INST FI EM ACOES	0,1786%	0,9851	3,6461%	20,9683%	0,15%	67.194.605,24	22
8	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	0,1653%	0,9836	3,6396%	21,0225%	0,90%	201.348.396,87	22
9	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	0,1649%	0,9869	3,6476%	21,0930%	0,00%	320.617.917,86	22
10	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	0,1619%	0,9674	3,5964%	20,6897%	0,00%	210.596.633,36	22
11	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,1467%	0,9825	3,6253%	21,0566%	0,09%	532.512.358,07	22
12	BRADESCO FIA SALUBRE	0,1454%	0,9752	3,5972%	20,8311%	0,50%	137.570.409,64	22
13	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	0,1403%	0,9819	3,6175%	21,0448%	0,01%	532.794.842,98	22
14	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	0,1242%	0,9975	3,6248%	21,2414%	0,15%	184.109.717,66	22
15	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	0,0876%	0,9993	3,5968%	21,3141%	0,00%	1.125.805.840,15	22
16	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	0,0813%	0,9691	3,5297%	20,7896%	0,00%	95.305.847,19	22
17	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	0,0748%	0,9931	3,6043%	21,4902%	2,00%	370.273.659,11	22
18	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	0,0523%	0,9993	3,5615%	21,3138%	0,30%	49.033.925,45	22
19	OCEANA VALOR FC FI ACOES	0,0513%	0,9980	3,5906%	21,5771%	2,00%	326.252.365,83	22
20	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,0471%	0,9880	3,5329%	21,1090%	0,70%	10.928.347,12	22
21	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,0403%	0,9980	3,5463%	21,2854%	0,10%	513.667.267,76	22
22	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	0,0265%	0,9739	3,4766%	20,7920%	0,16%	37.632.390,76	22
23	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	0,0198%	0,9974	3,5243%	21,2719%	0,19%	46.565.545,51	22
24	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,0001%	0,9892	3,4910%	21,1502%	0,56%	73.157.475,90	22
25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-0,0006%	0,9960	3,5011%	21,2466%	0,15%	140.306.027,86	22
26	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-0,0149%	0,9518	3,3960%	20,4298%	0,75%	63.405.057,44	22
27	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-0,0228%	0,9320	3,3917%	20,4592%	0,75%	90.308.721,18	22
28	MULTIPREV FIA	-0,0803%	1,0120	3,4667%	21,6625%	0,00%	691.455.219,30	22
29	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-0,1532%	1,0117	3,3745%	21,4891%	0,00%	186.150.395,01	22
30	COMSHELL CONCHA FIA	-0,1697%	0,9896	3,3271%	21,1935%	0,17%	65.058.012,42	22
31	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-0,2667%	0,9507	3,2669%	21,5570%	0,35%	7.982.427,07	22
32	DAHLIA ACOES FC FIA	-0,2693%	1,0172	3,3696%	22,6180%	1,85%	188.005.907,76	22
33	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-0,3556%	1,0373	3,3287%	23,1487%	1,70%	98.849.539,31	22
	MÉDIA:	0,1174%	0,9844	3,6118%	21,2165%		234.587.974,15	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/02/2022 A 31/01/2023
 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	9,7173%	7,5576%	0,8823	19,2887%	0,41%	456.159.457,98	252
2	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	8,9650%	7,3640%	0,9289	20,1636%	0,75%	90.308.721,18	252
3	RPS FIC FI ACOES SELECTION	5,8283%	4,9091%	0,9850	21,9430%	1,70%	98.849.539,31	252
4	IAJA SAM ACOES FI	4,9509%	4,2983%	1,0079	21,6446%	0,22%	141.760.103,57	252
5	OCEANA VALOR FC FI ACOES	4,7952%	3,1141%	0,9230	20,2425%	2,00%	326.252.365,83	252
6	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	4,6591%	3,1483%	0,9368	20,4266%	2,00%	370.273.659,11	252
7	IAJA ACOES FC FIA	3,8396%	3,0264%	0,9945	21,3639%	0,08%	222.782.699,52	252
8	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	2,9842%	2,0861%	0,9878	21,0919%	0,00%	320.617.917,86	252
9	BRAM FIA IBRX ATIVO	2,9626%	2,0831%	0,9893	21,1233%	0,00%	387.105.145,94	252
10	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	2,9273%	2,0413%	0,9888	21,1148%	0,00%	134.672.219,33	252
11	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	2,7716%	2,3183%	1,0246	21,8973%	0,70%	32.034.666,90	252
12	BRADESCO FIA SALUBRE	2,2943%	1,3080%	0,9805	20,9379%	0,50%	137.570.409,64	252
13	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	2,1980%	1,1779%	0,9777	20,8658%	0,00%	210.596.633,36	252
14	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	2,0865%	1,1923%	0,9881	21,0997%	0,70%	10.928.347,12	252
15	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	1,9691%	1,0929%	0,9896	21,1294%	0,90%	201.348.396,87	252
16	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	1,7895%	0,7678%	0,9775	20,8680%	0,00%	95.305.847,19	252
17	MULTIPREV FIA	1,7883%	0,7489%	0,9760	20,8625%	0,00%	691.455.219,30	252
18	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	1,5029%	0,5567%	0,9838	20,9877%	0,16%	37.632.390,76	252
19	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	1,4695%	0,7260%	1,0006	21,3451%	0,00%	1.125.805.840,15	252
20	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	1,4419%	0,7633%	1,0059	21,4664%	0,00%	186.150.395,01	252
21	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	1,2979%	0,5473%	1,0000	21,3327%	0,15%	184.109.717,66	252
22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	1,1509%	0,3123%	0,9927	21,1775%	0,15%	140.306.027,86	252
23	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	1,1343%	0,3060%	0,9936	21,1957%	0,19%	46.565.545,51	252
24	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	1,0930%	0,3464%	1,0003	21,3396%	0,30%	49.033.925,45	252
25	COMSHELL CONCHA FIA	1,0749%	0,1382%	0,9846	21,0053%	0,17%	65.058.012,42	252
26	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	1,0243%	-0,1355%	0,9660	20,6249%	0,75%	63.405.057,44	252
27	SANTANDER FI IBRX ACOES	0,9791%	0,1963%	0,9973	21,2756%	0,10%	513.667.267,76	252
28	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	0,7049%	-0,0592%	0,9988	21,3241%	0,56%	73.157.475,90	252
29	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	0,4374%	-0,5475%	0,9803	21,0460%	0,35%	7.982.427,07	252
30	BB ECO GOLD FI EM ACOES	0,1102%	-0,6825%	0,9964	21,2620%	0,09%	532.512.358,07	252
31	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-0,1572%	-0,9690%	0,9948	21,2297%	0,01%	532.794.842,98	252
32	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-0,8037%	-1,8328%	0,9769	20,9521%	0,15%	67.194.605,24	252
33	DAHLIA ACOES FC FIA	-2,9466%	-3,7564%	0,9940	22,5399%	1,85%	188.005.907,76	252
	MÉDIA:	2,3043%	1,3377%	0,9819	21,0960%		234.587.974,15	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 01/11/2022 A 31/01/2023
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

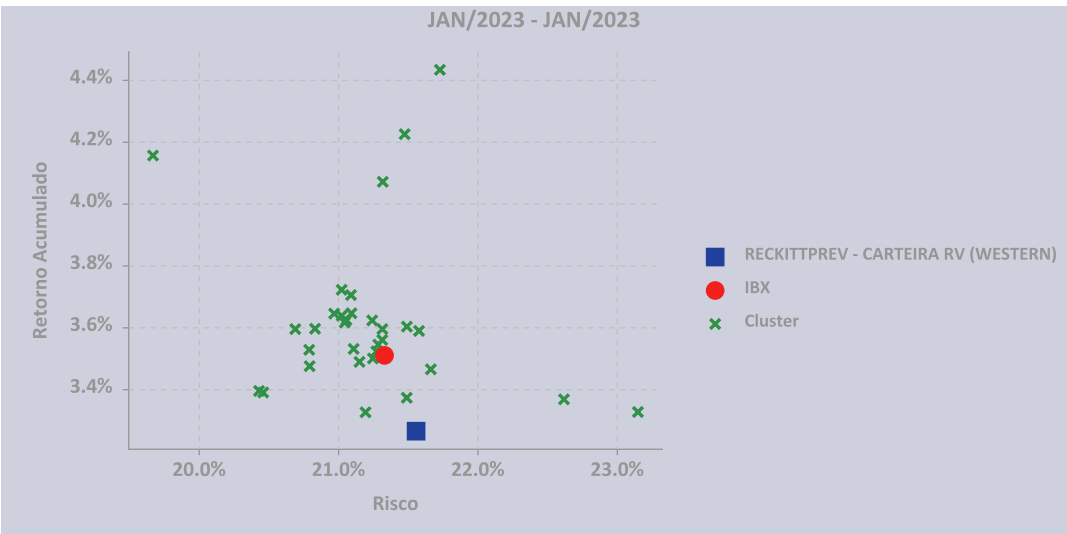
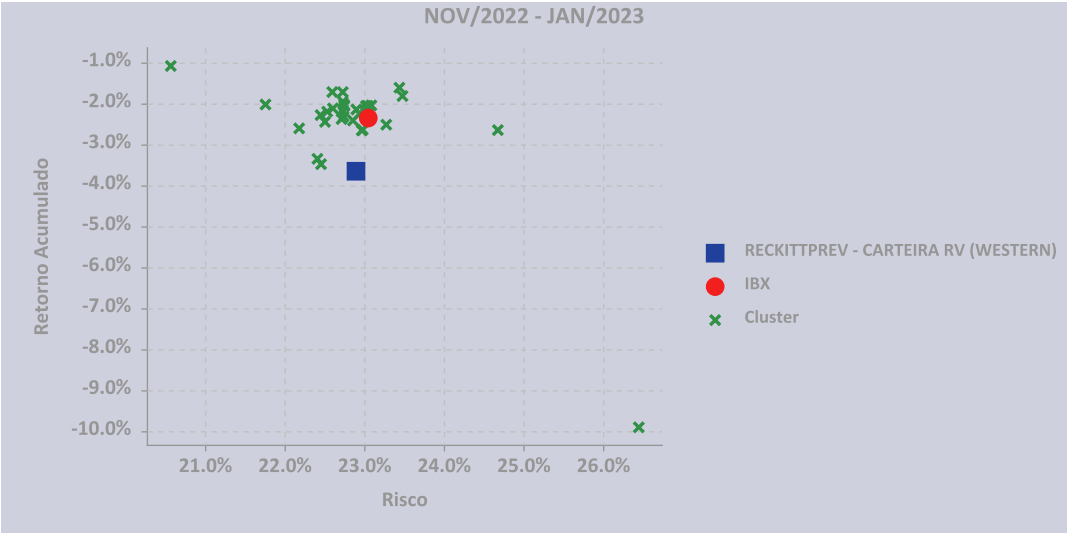
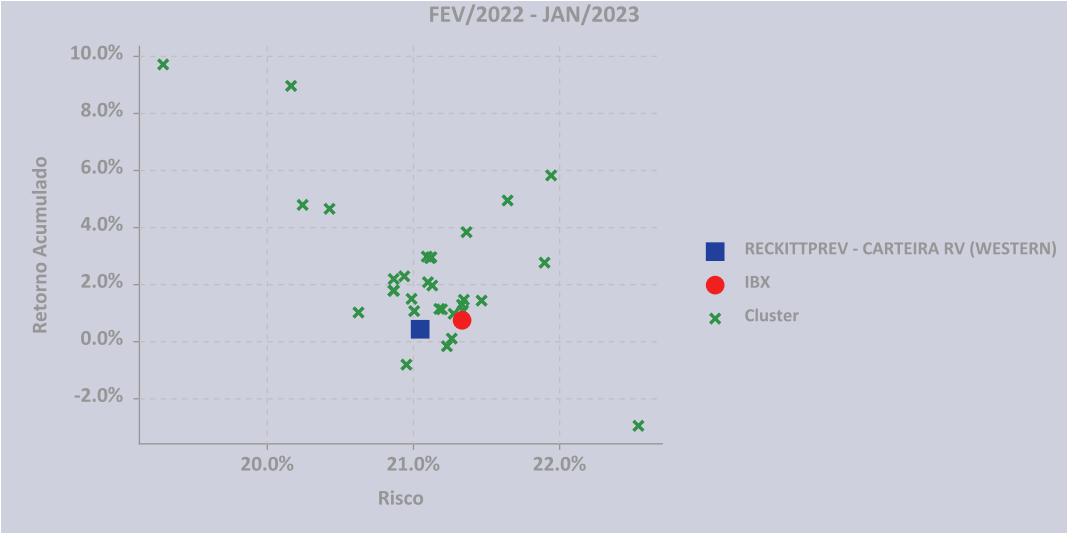
RANKING	FUNDO	RETORNO ACUMULADO	JENSEN	BETA	RISCO TOTAL ANUALIZADO	TAXA ADM.	PATRIMÔNIO	PONTOS
1	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	-1,0676%	0,5636%	0,8551	20,5637%	0,41%	456.159.457,98	64
2	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-1,5972%	0,8305%	1,0164	23,4344%	0,70%	32.034.666,90	64
3	CITIPREVI INST FI EM ACOES	-1,7032%	0,5092%	0,9751	22,5914%	0,15%	67.194.605,24	64
4	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	-1,7050%	0,5526%	0,9862	22,7231%	0,56%	73.157.475,90	64
5	IAJA SAM ACOES FI	-1,8015%	0,6016%	0,9996	23,4732%	0,22%	141.760.103,57	64
6	BRAM FIA IBRX ATIVO	-1,9371%	0,3213%	0,9843	22,7234%	0,00%	387.105.145,94	64
7	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	-2,0074%	-0,0898%	0,9101	21,7528%	0,75%	90.308.721,18	64
8	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	-2,0118%	0,2508%	0,9850	22,7407%	0,00%	134.672.219,33	64
9	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	-2,0293%	0,3178%	1,0035	23,0824%	0,00%	186.150.395,01	64
10	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	-2,0401%	0,2966%	0,9996	23,0363%	0,00%	1.125.805.840,15	64
11	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	-2,0444%	0,2868%	0,9990	23,0144%	0,15%	184.109.717,66	64
12	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	-2,0460%	0,2173%	0,9857	22,7432%	0,00%	320.617.917,86	64
13	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	-2,1030%	0,1265%	0,9797	22,5998%	0,16%	37.632.390,76	64
14	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	-2,1292%	0,1724%	0,9938	22,8944%	0,15%	140.306.027,86	64
15	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	-2,1304%	0,2047%	0,9993	23,0301%	0,30%	49.033.925,45	64
16	SANTANDER FI IBRX ACOES	-2,1547%	0,1729%	0,9979	22,9996%	0,10%	513.667.267,76	64
17	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	-2,1728%	0,0869%	0,9846	22,7287%	0,90%	201.348.396,87	64
18	BRADESCO FIA SALUBRE	-2,1818%	0,0287%	0,9752	22,5279%	0,50%	137.570.409,64	64
19	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	-2,2364%	0,0744%	0,9945	22,9311%	0,19%	46.565.545,51	64
20	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	-2,2662%	-0,0762%	0,9702	22,4440%	0,00%	210.596.633,36	64
21	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-2,3027%	-0,0418%	0,9857	22,7334%	0,70%	10.928.347,12	64
22	COMSHELL CONCHA FIA	-2,3624%	-0,1065%	0,9831	22,7081%	0,17%	65.058.012,42	64
23	MULTIPREV FIA	-2,3995%	-0,1127%	0,9875	22,8516%	0,00%	691.455.219,30	64
24	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	-2,4321%	-0,2292%	0,9710	22,5005%	0,00%	95.305.847,19	64
25	IAJA ACOES FC FIA	-2,5008%	-0,1522%	0,9900	23,2698%	0,08%	222.782.699,52	64
26	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	-2,5900%	-0,4668%	0,9567	22,1752%	0,75%	63.405.057,44	64
27	BB ECO GOLD FI EM ACOES	-2,6255%	-0,3057%	0,9928	22,9746%	0,09%	532.512.358,07	64
28	RPS FIC FI ACOES SELECTION	-2,6324%	-0,0796%	1,0304	24,6716%	1,70%	98.849.539,31	64
29	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	-2,6406%	-0,3241%	0,9923	22,9614%	0,01%	532.794.842,98	64
30	OCEANA VALOR FC FI ACOES	-3,3343%	-1,2324%	0,9588	22,4048%	2,00%	326.252.365,83	64
31	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	-3,4638%	-1,3257%	0,9645	22,4509%	2,00%	370.273.659,11	64
32	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	-3,6373%	-1,4039%	0,9673	22,8894%	0,35%	7.982.427,07	64
33	DAHLIA ACOES FC FIA	-9,8890%	-7,0284%	1,0515	26,4418%	1,85%	188.005.907,76	64
	MÉDIA:	-2,4902%	-0,2230%	0,9826	22,8808%		234.587.974,15	

RETORNO ACUMULADO

PERÍODO DA ANÁLISE: 02/01/2023 A 31/01/2023
 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	IAJA SAM ACOES FI	4,4346%	0,8906%	0,9911	21,7273%	0,22%	141.760.103,57	22
2	IAJA ACOES FC FIA	4,2260%	0,7110%	0,9823	21,4749%	0,08%	222.782.699,52	22
3	SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	4,1578%	0,8676%	0,8824	19,6688%	0,41%	456.159.457,98	22
4	ITAU IAJA FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	4,0722%	0,5643%	0,9947	21,3175%	0,70%	32.034.666,90	22
5	BRAM FIA IBRX ATIVO	3,7235%	0,2474%	0,9835	21,0224%	0,00%	387.105.145,94	22
6	BRAM H FI ACOES INSTITUCIONAL	3,7060%	0,2223%	0,9871	21,0900%	0,00%	134.672.219,33	22
7	BRADESCO FIA IBRX MULTIPATROCINADO	3,6476%	0,1636%	0,9869	21,0930%	0,00%	320.617.917,86	22
8	CITIPREVI INST FI EM ACOES	3,6461%	0,1807%	0,9851	20,9683%	0,15%	67.194.605,24	22
9	BRAD FC DE FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	3,6396%	0,1635%	0,9836	21,0225%	0,90%	201.348.396,87	22
10	BB ECO GOLD FI EM ACOES	3,6253%	0,1458%	0,9825	21,0566%	0,09%	532.512.358,07	22
11	TURQUOISE PREVISIEMENS PLAN FIA PREV	3,6248%	0,1237%	0,9975	21,2414%	0,15%	184.109.717,66	22
12	BB ECO STOCKS FC FI EM ACOES	3,6175%	0,1393%	0,9819	21,0448%	0,01%	532.794.842,98	22
13	OCEANA VALOR 30 FC FI DE ACOES	3,6043%	0,0949%	0,9931	21,4902%	2,00%	370.273.659,11	22
14	BRADESCO FIA SALUBRE	3,5972%	0,1426%	0,9752	20,8311%	0,50%	137.570.409,64	22
15	ITAU INDEX ACOES IBRX FI	3,5968%	0,0876%	0,9993	21,3141%	0,00%	1.125.805.840,15	22
16	WA PREV IBRX ATIVO ACOES FI	3,5964%	0,1578%	0,9674	20,6897%	0,00%	210.596.633,36	22
17	OCEANA VALOR FC FI ACOES	3,5906%	0,0708%	0,9980	21,5771%	2,00%	326.252.365,83	22
18	ITAU ACOES IBRX INDEXADO FC	3,5615%	0,0523%	0,9993	21,3138%	0,30%	49.033.925,45	22
19	SANTANDER FI IBRX ACOES	3,5463%	0,0403%	0,9980	21,2854%	0,10%	513.667.267,76	22
20	BRADESCO FIA INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	3,5329%	0,0470%	0,9880	21,1090%	0,70%	10.928.347,12	22
21	WA PREV IBRX ALPHA MASTER ACOES FI	3,5297%	0,0803%	0,9691	20,7896%	0,00%	95.305.847,19	22
22	FIA VALUE PREV IBRX ATIVO	3,5243%	0,0198%	0,9974	21,2719%	0,19%	46.565.545,51	22
23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES FUNEPP	3,5011%	-0,0005%	0,9960	21,2466%	0,15%	140.306.027,86	22
24	ICATU VANGUARDA ACOES IBX FI	3,4910%	0,0004%	0,9892	21,1502%	0,56%	73.157.475,90	22
25	MBPREV V FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES	3,4766%	0,0259%	0,9739	20,7920%	0,16%	37.632.390,76	22
26	MULTIPREV FIA	3,4667%	-0,0790%	1,0120	21,6625%	0,00%	691.455.219,30	22
27	WESTERN ASSET PREV IBRX ALPHA ACOES FC F	3,3960%	-0,0131%	0,9518	20,4298%	0,75%	63.405.057,44	22
28	SHARP VALOR PERNAMBUCO FIA	3,3917%	0,0126%	0,9320	20,4592%	0,75%	90.308.721,18	22
29	ITAU PREVIDENCIA IBRX FIA	3,3745%	-0,1538%	1,0117	21,4891%	0,00%	186.150.395,01	22
30	DAHLIA ACOES FC FIA	3,3696%	-0,2454%	1,0172	22,6180%	1,85%	188.005.907,76	22
31	RPS FIC FI ACOES SELECTION	3,3287%	-0,3225%	1,0373	23,1487%	1,70%	98.849.539,31	22
32	COMSHELL CONCHA FIA	3,3271%	-0,1684%	0,9896	21,1935%	0,17%	65.058.012,42	22
33	RECKITTPREV - CARTEIRA RV (WESTERN)	3,2669%	-0,1878%	0,9507	21,5570%	0,35%	7.982.427,07	22
	MÉDIA:	3,6118%	0,1237%	0,9844	21,2165%		234.587.974,15	

MAPA DE RISCO X RETORNO





*Agrupamento: -.-
MULTIMERCADOS*

Janeiro/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: 1,78968
 PATRIMÔNIO: 15.717.027,88

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	87,89%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	1,22%	SMLL	0,35%
IDIV	0,00%	IRF-M	5,30%
IMA B 5	5,24%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 34,56%

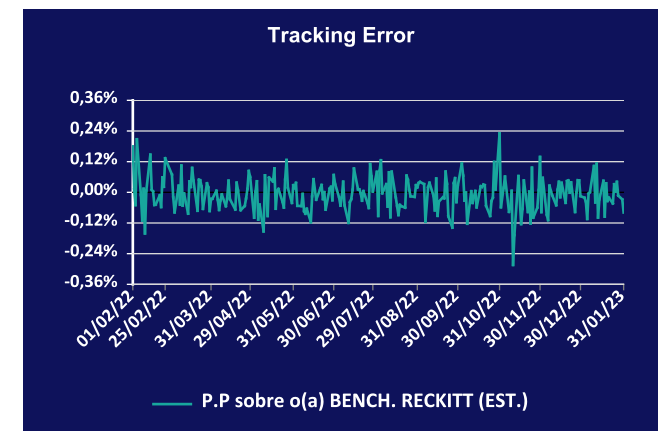
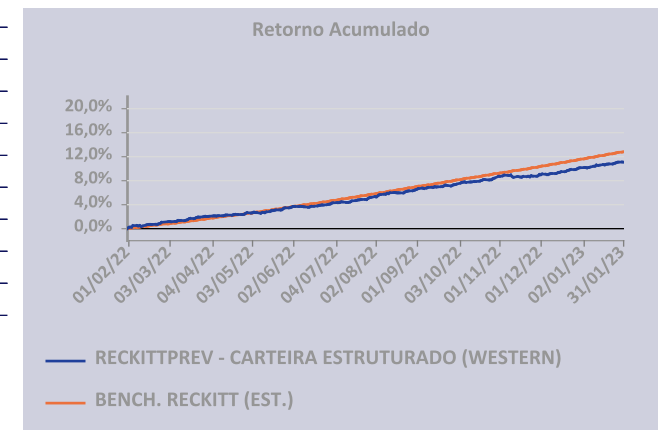
SELEÇÃO: 65,44%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0061%	--
RETORNO ACUMULADO	11,0777%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	12,8273%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,7496%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0108	--
SHARPE	-0,0925	--
SORTINO	-0,1231	--
STERLING RATIO	-0,1214	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,2917	--
DOWNSIDE RISK	0,0502%	--
RISCO ATIVO	0,0667%	--
RISCO TOTAL	0,0665%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,0566%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	12
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (EST.)	4
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (EST.)	8
MAIOR RETORNO MENSAL	1,2183%(10/2022)
MENOR RETORNO MENSAL	0,2672%(11/2022)



QUADRO COMPARATIVO DE RETORNOS

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	MELHOR DIA	PIOR DIA
FUNDO	0,85%	0,85%	11,08%	12,07%	13,54%	0,28% (31/10/2022)	-0,23% (10/11/2022)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,03% (02/02/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,03% (02/02/2022)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)

COMENTÁRIOS DO ANALISTA

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

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: 1,78968
 PATRIMÔNIO: 15.717.027,88

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	86,02%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,29%
IDIV	0,00%	IRF-M	9,63%
IMA B 5	4,06%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 34,31%

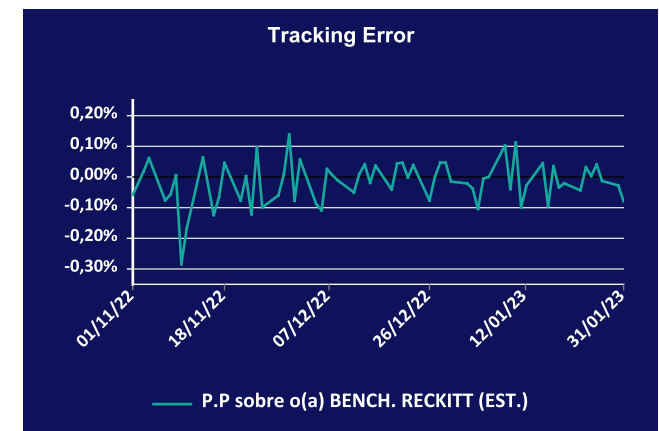
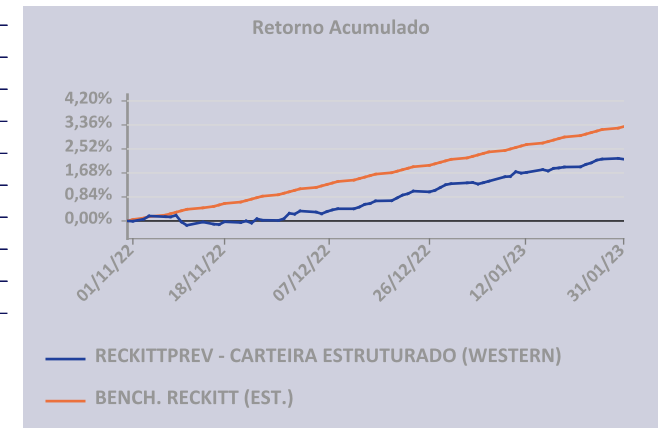
SELEÇÃO: 65,69%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0173%	--
RETORNO ACUMULADO	2,1610%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	3,3029%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,1419%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0435	--
SHARPE	-0,2430	--
SORTINO	-0,2746	--
STERLING RATIO	-0,2543	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	4,6212	--
DOWNSIDE RISK	0,0631%	--
RISCO ATIVO	0,0713%	--
RISCO TOTAL	0,0713%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	1,1332%	--

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	0,2672%(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	0,85%	0,85%	11,08%	12,07%	13,54%	0,19% (30/11/2022)	-0,23% (10/11/2022)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (18/11/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (18/11/2022)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	2,75% (24/11/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	2,78% (24/11/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	3,21% (24/11/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	3,52% (24/11/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	3,37% (11/11/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,46% (29/11/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,75% (29/11/2022)	-2,27% (10/11/2022)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,55% (29/11/2022)	-0,78% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,78% (10/11/2022)	-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: 1,78968
 PATRIMÔNIO: 15.717.027,88

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	97,63%	IBOVESPA	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	0,16%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,90%
IMA-C	1,30%	DÓLAR PTAX	0,00%

ESTILO: 2,59%

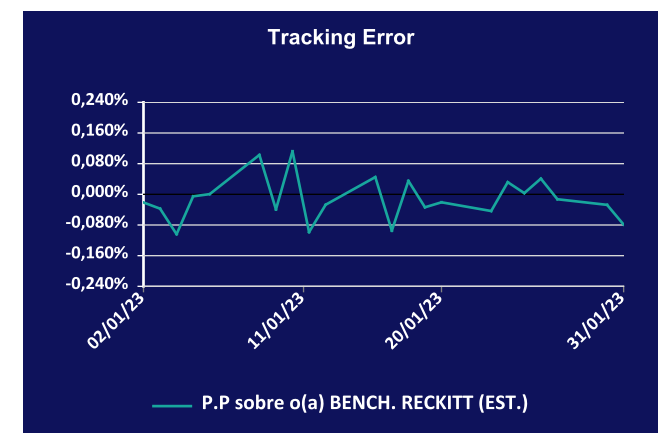
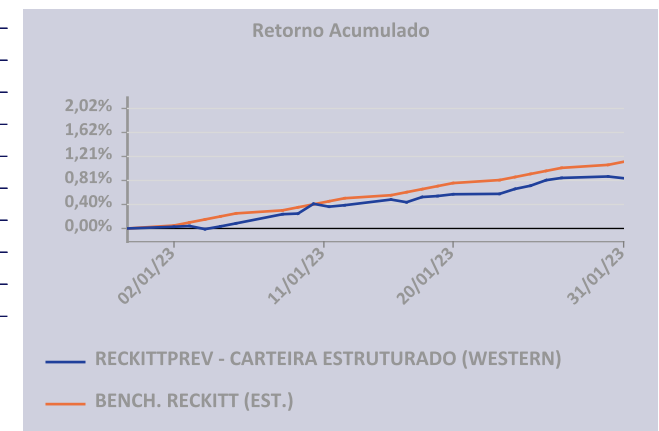
SELEÇÃO: 97,41%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0124%	--
RETORNO ACUMULADO	0,8467%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,1233%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-0,2766%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,1400	--
SHARPE	-0,2155	--
SORTINO	-0,2772	--
STERLING RATIO	-0,2864	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,6138	--
DOWNSIDE RISK	0,0448%	--
RISCO ATIVO	0,0577%	--
RISCO TOTAL	0,0577%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	0,9163%	--

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	0,8467%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	0,8467%(01/2023)



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	0,85%	0,85%	11,08%	12,07%	13,54%	0,16% (11/01/2023)	-0,05% (04/01/2023)
BENCH. RECKITT (EST.)	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (24/01/2023)	0,05% (18/01/2023)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (24/01/2023)	0,05% (18/01/2023)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	2,19% (05/01/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	2,12% (05/01/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	2,09% (05/01/2023)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	3,06% (10/01/2023)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	2,12% (17/01/2023)	-2,39% (02/01/2023)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,39% (05/01/2023)	-0,36% (16/01/2023)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,35% (10/01/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,10% (11/01/2023)	-1,18% (20/01/2023)
IMA-GERAL	0,70%	0,70%	10,20%	11,76%	16,79%	0,31% (11/01/2023)	-0,26% (02/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)



*Agrupamento: -.-
INVEST. NO EXTERIOR*

Janeiro/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: 2,64078
 PATRIMÔNIO: 9.660.498,67

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	65,90%
DÓLAR PTAX	34,10%		

ESTILO: 58,66%

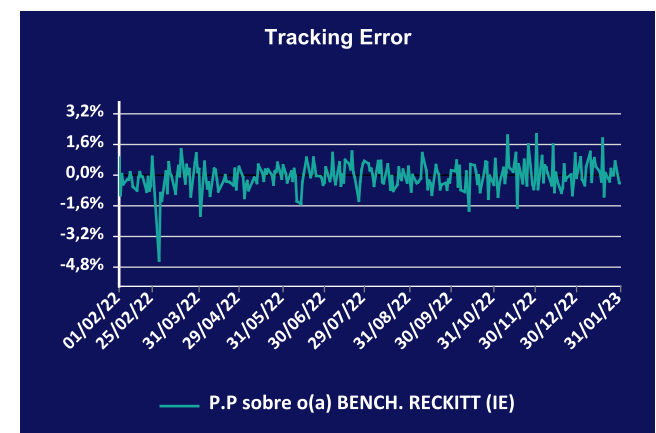
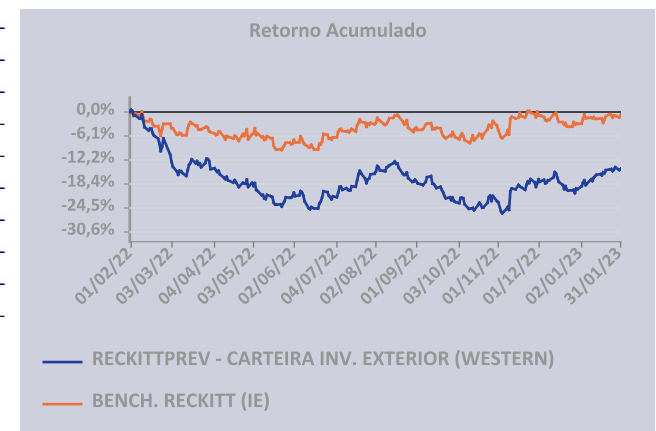
SELEÇÃO: 41,34%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,1035%	--
RETORNO ACUMULADO	-14,4815%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	-0,6001%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-13,8813%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	-0,0058	--
SHARPE	-0,0909	--
SORTINO	-0,1232	--
STERLING RATIO	-0,0641	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	8,5891	--
DOWNSIDE RISK	0,8399%	--
RISCO ATIVO	0,7090%	--
RISCO TOTAL	1,1392%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	18,0848%	--

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	6,47%	6,47%	-14,48%	-9,79%	16,85%	6,32% (10/11/2022)	-4,41% (02/03/2022)
BENCH. RECKITT (IE)	2,48%	2,48%	-0,60%	11,60%	39,25%	4,26% (10/11/2022)	-2,68% (29/04/2022)
MSCI EUROPE	8,61%	8,61%	-5,81%	3,74%	8,18%	6,22% (09/03/2022)	-5,06% (24/02/2022)
MSCI WORLD	7,00%	7,00%	-8,96%	4,63%	18,89%	5,05% (10/11/2022)	-3,66% (13/09/2022)
DÓLAR D2	-3,80%	-3,80%	-4,22%	-7,15%	18,72%	4,38% (22/04/2022)	-3,87% (03/10/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	3,15% (25/04/2022)	-3,82% (03/10/2022)
EURO PTAX	-0,55%	-0,55%	-7,80%	-16,75%	17,06%	4,34% (10/11/2022)	-3,57% (03/10/2022)
MSCI WORLD - BRL PTAX	4,58%	4,58%	-13,34%	-2,56%	42,00%	7,97% (10/11/2022)	-4,10% (29/04/2022)
MSCI WORLD - BRL D2	2,94%	2,94%	-12,80%	-2,85%	41,15%	8,97% (10/11/2022)	-3,74% (26/08/2022)
S&P 500	6,18%	6,18%	-9,72%	9,76%	26,39%	5,54% (10/11/2022)	-4,32% (13/09/2022)
S&P 500 BRL PTAX	3,77%	3,77%	-14,07%	2,21%	50,95%	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: 2,64078
 PATRIMÔNIO: 9.660.498,67

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	73,79%
DÓLAR PTAX	26,21%		

ESTILO: 58,28%

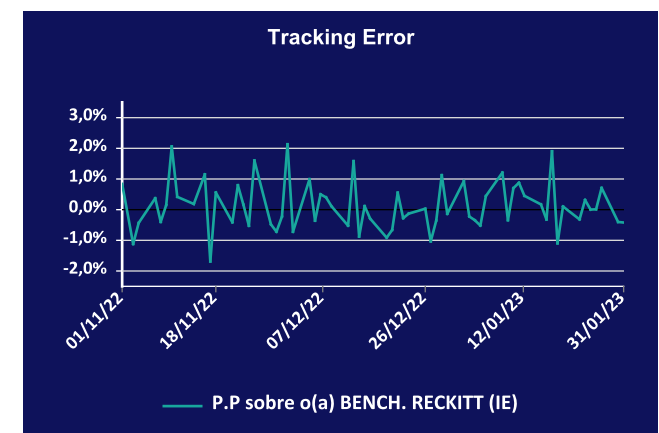
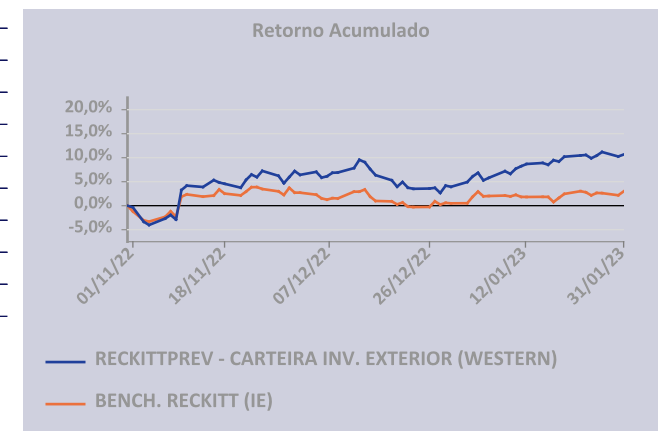
SELEÇÃO: 41,72%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,1149%	--
RETORNO ACUMULADO	10,6541%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,9743%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	7,6797%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,0139	--
SHARPE	0,0931	--
SORTINO	0,1650	--
STERLING RATIO	0,0841	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	3,0292	--
DOWNSIDE RISK	0,6963%	--
RISCO ATIVO	0,7963%	--
RISCO TOTAL	1,2334%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	19,5800%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	3
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	0
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	6,47%	6,47%	-14,48%	-9,79%	16,85%	6,32% (10/11/2022)	-3,00% (03/11/2022)
BENCH. RECKITT (IE)	2,48%	2,48%	-0,60%	11,60%	39,25%	4,26% (10/11/2022)	-1,88% (03/11/2022)
MSCI EUROPE	8,61%	8,61%	-5,81%	3,74%	8,18%	4,22% (10/11/2022)	-2,81% (15/12/2022)
MSCI WORLD	7,00%	7,00%	-8,96%	4,63%	18,89%	5,05% (10/11/2022)	-2,53% (15/12/2022)
DÓLAR D2	-3,80%	-3,80%	-4,22%	-7,15%	18,72%	3,73% (10/11/2022)	-2,22% (06/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,78% (10/11/2022)	-2,17% (06/01/2023)
EURO PTAX	-0,55%	-0,55%	-7,80%	-16,75%	17,06%	4,34% (10/11/2022)	-2,16% (01/11/2022)
MSCI WORLD - BRL PTAX	4,58%	4,58%	-13,34%	-2,56%	42,00%	7,97% (10/11/2022)	-3,37% (03/11/2022)
MSCI WORLD - BRL D2	2,94%	2,94%	-12,80%	-2,85%	41,15%	8,97% (10/11/2022)	-3,03% (03/11/2022)
S&P 500	6,18%	6,18%	-9,72%	9,76%	26,39%	5,54% (10/11/2022)	-3,53% (03/11/2022)
S&P 500 BRL PTAX	3,77%	3,77%	-14,07%	2,21%	50,95%	8,48% (10/11/2022)	-3,82% (03/11/2022)

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: 2,64078
 PATRIMÔNIO: 9.660.498,67

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	66,74%
DÓLAR PTAX	33,26%		

ESTILO: 59,14%

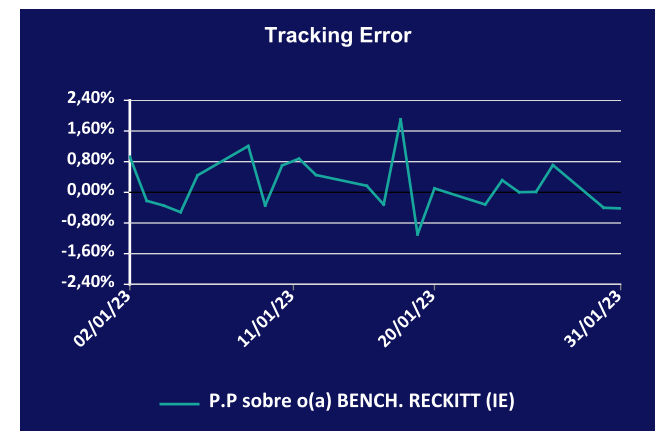
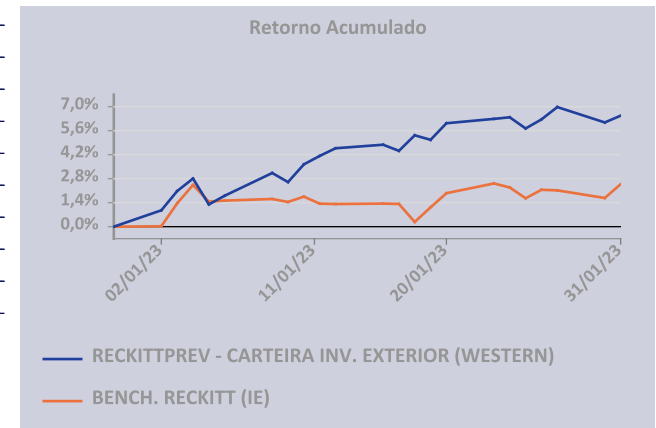
SELEÇÃO: 40,86%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	0,2371%	--
RETORNO ACUMULADO	6,4744%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,4777%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	3,9966%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
BURKE RATIO	0,1188	--
SHARPE	0,3365	--
SORTINO	0,5495	--
STERLING RATIO	0,3384	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	2,9130	--
DOWNSIDE RISK	0,4315%	--
RISCO ATIVO	0,6857%	--
RISCO TOTAL	0,7045%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	11,1845%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	1
MESES NEGATIVOS	0
MESES ACIMA DO BENCH. RECKITT (IE)	1
MESES ABAIXO DO BENCH. RECKITT (IE)	0
MAIOR RETORNO MENSAL	6,4745%(01/2023)
MENOR RETORNO MENSAL	6,4745%(01/2023)



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	6,47%	6,47%	-14,48%	-9,79%	16,85%	1,30% (09/01/2023)	-1,47% (05/01/2023)
BENCH. RECKITT (IE)	2,48%	2,48%	-0,60%	11,60%	39,25%	1,34% (03/01/2023)	-1,04% (18/01/2023)
MSCI EUROPE	8,61%	8,61%	-5,81%	3,74%	8,18%	2,16% (09/01/2023)	-1,91% (19/01/2023)
MSCI WORLD	7,00%	7,00%	-8,96%	4,63%	18,89%	2,12% (06/01/2023)	-1,13% (05/01/2023)
DÓLAR D2	-3,80%	-3,80%	-4,22%	-7,15%	18,72%	1,56% (03/01/2023)	-2,22% (06/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)
EURO PTAX	-0,55%	-0,55%	-7,80%	-16,75%	17,06%	2,31% (02/01/2023)	-1,57% (05/01/2023)
MSCI WORLD - BRL PTAX	4,58%	4,58%	-13,34%	-2,56%	42,00%	2,59% (02/01/2023)	-1,92% (05/01/2023)
MSCI WORLD - BRL D2	2,94%	2,94%	-12,80%	-2,85%	41,15%	1,68% (20/01/2023)	-2,70% (05/01/2023)
S&P 500	6,18%	6,18%	-9,72%	9,76%	26,39%	2,28% (06/01/2023)	-1,56% (18/01/2023)
S&P 500 BRL PTAX	3,77%	3,77%	-14,07%	2,21%	50,95%	2,62% (03/01/2023)	-2,12% (18/01/2023)

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)*

Janeiro/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: 2,41851
 PATRIMÔNIO: 141.073.419,32

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

	CDI	IBX	5,04%
	84,18%		
	2,94%	SMLL	2,02%
	0,00%	IRF-M	3,67%
	0,00%	IMA B 5+	0,00%
	0,00%	DÓLAR PTAX	2,14%

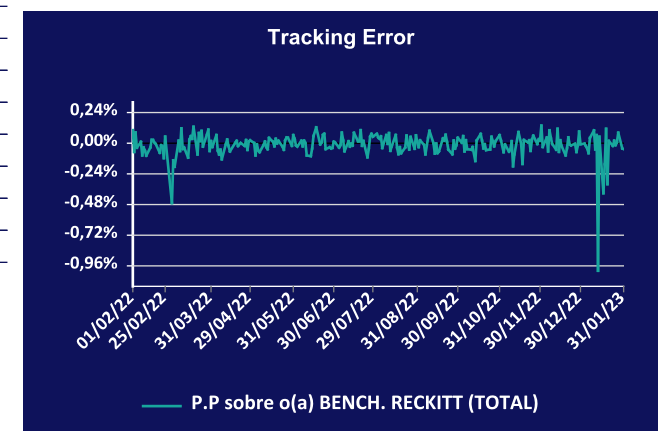
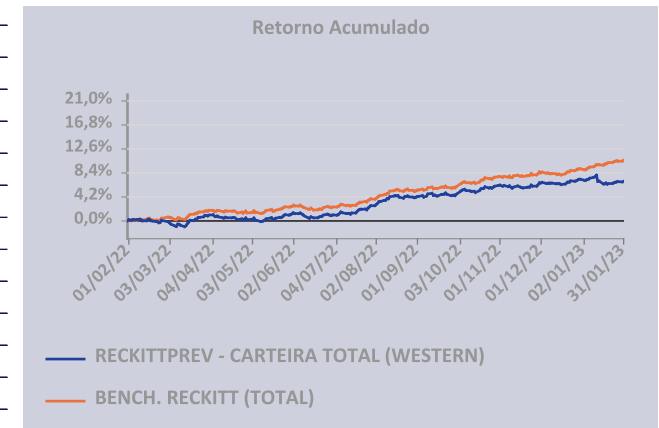
ESTILO: 63,90% | SELEÇÃO: 36,10%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0210%	--
RETORNO ACUMULADO	6,9493%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	10,6446%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-3,6952%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0160%	--
BETA	0,0972	--
MARKET TIMING	-0,0859	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,5769	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	94,3599%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	100,0000%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	27,0351%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-2,2358	--
JENSEN	-4,7013%	--
MODIGLIANI	-33,7324%	--
SHARPE	-0,1224	--
SORTINO	-0,1494	--
TREYNOR	-0,0021	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	48,9676	--
DOWNSIDE RISK	0,1411%	--
RISCO ATIVO	0,0953%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	1,5139%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1122%	--
RISCO TOTAL	0,1724%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,7372%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	9
MESES NEGATIVOS	3
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	-0,33%	-0,33%	6,95%	7,81%	13,26%	0,48% (03/10/2022)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,39%	1,39%	10,64%	16,63%	23,52%	0,48% (03/10/2022)	-0,33% (05/05/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,03% (02/02/2022)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	5,54% (03/10/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	5,59% (03/10/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	5,46% (03/10/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	5,13% (03/10/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	5,36% (03/10/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,56% (04/08/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,99% (04/08/2022)	-2,27% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	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: 2,41851
 PATRIMÔNIO: 141.073.419,32

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	91,95%	IBX	2,60%
IVBX-2	0,00%	SMLL	4,21%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	1,24%

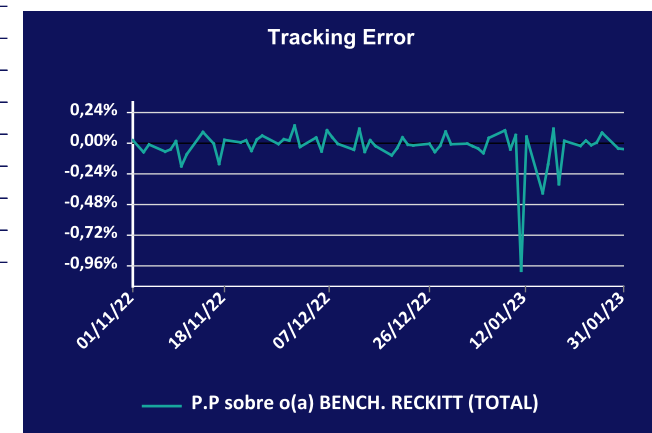
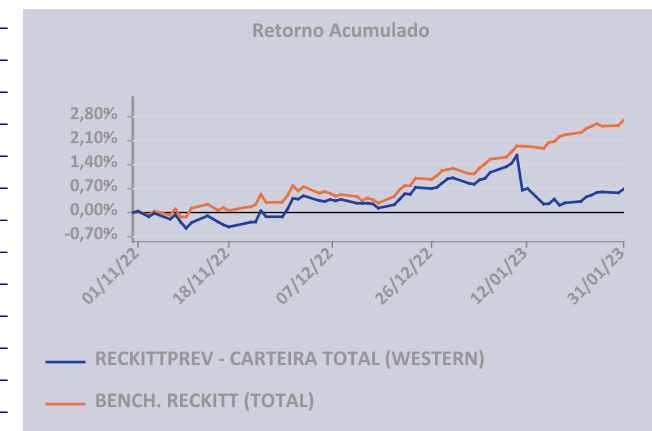
ESTILO: 35,96% | SELEÇÃO: 64,04%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0399%	--
RETORNO ACUMULADO	0,6822%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	2,6932%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-2,0110%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0479%	--
BETA	0,0783	--
MARKET TIMING	0,6719	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,3371	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	93,2303%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	99,9998%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	57,7342%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-3,2200	--
JENSEN	-2,2021%	--
MODIGLIANI	-14,6486%	--
SHARPE	-0,2132	--
SORTINO	-0,2288	--
TREYNOR	-0,0053	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	26,5166	--
DOWNSIDE RISK	0,1747%	--
RISCO ATIVO	0,1518%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	2,4111%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,1534%	--
RISCO TOTAL	0,1874%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	2,9764%	--

PERFIL DE RETORNOS

MESES POSITIVOS	2
MESES NEGATIVOS	1
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	-0,33%	-0,33%	6,95%	7,81%	13,26%	0,32% (24/11/2022)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,39%	1,39%	10,64%	16,63%	23,52%	0,30% (24/11/2022)	-0,23% (09/11/2022)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (14/12/2022)	0,05% (18/11/2022)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	2,75% (24/11/2022)	-3,35% (10/11/2022)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	2,78% (24/11/2022)	-3,41% (10/11/2022)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	3,21% (24/11/2022)	-4,03% (10/11/2022)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	3,52% (24/11/2022)	-6,10% (10/11/2022)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	3,37% (11/11/2022)	-3,44% (10/11/2022)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,75% (29/11/2022)	-1,32% (10/11/2022)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,46% (29/11/2022)	-0,56% (10/11/2022)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,75% (29/11/2022)	-2,27% (10/11/2022)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,78% (10/11/2022)	-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: 2,41851
 PATRIMÔNIO: 141.073.419,32

SIMULAÇÃO - CRITÉRIOS

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

ANÁLISE DE ESTILO

CDI	85,46%	IBX	0,00%
IVBX-2	0,00%	SMLL	9,92%
IDIV	0,00%	IRF-M	0,00%
IMA B 5	0,00%	IMA B 5+	0,00%
IMA-C	0,00%	DÓLAR PTAX	4,61%

ESTILO: 35,10%

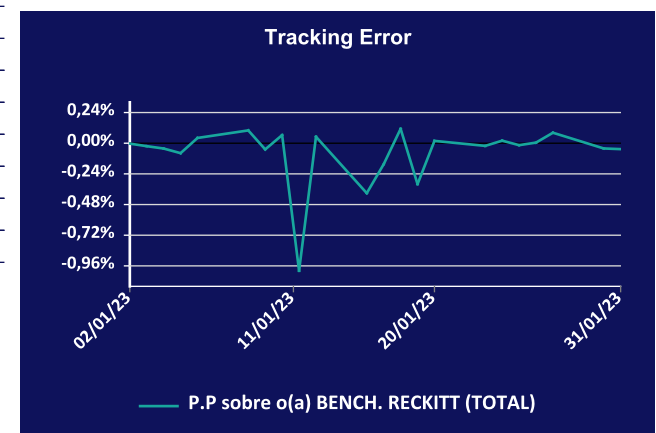
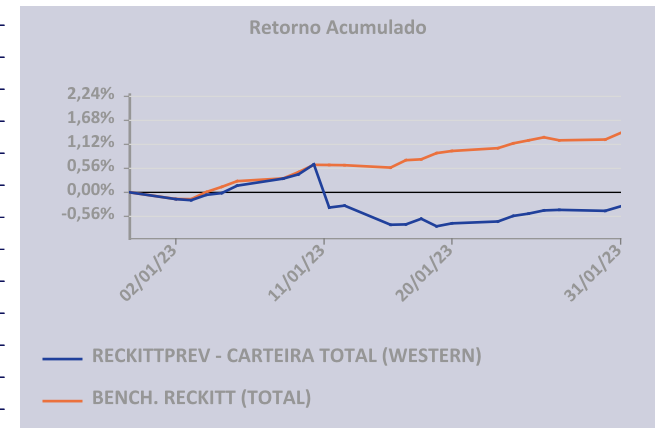
SELEÇÃO: 64,90%

DESEMPENHO

RETORNO		
PRÊMIO MÉDIO	-0,0652%	--
RETORNO ACUMULADO	-0,3253%	--
RETORNO DA REFERÊNCIA	1,3872%	--
RETORNO VS. REFERÊNCIA (EM P.P)	-1,7126%	--
REGRESSÃO DE ATRIBUIÇÃO		
ALFA	-0,0971%	--
BETA	0,0835	--
MARKET TIMING	1,2825	--
R^2 DA REGRESSÃO	0,1604	--
SIGNIFICÂNCIA DO ALFA	78,6112%	--
SIGNIFICÂNCIA DO BETA	92,5372%	--
SIGNIFICÂNCIA DO M.TIMING	33,4963%	--
ÍNDICES RETORNO/RISCO		
INFORMATION RATIO ANUALIZADO	-5,1219	--
JENSEN	-1,6311%	--
MODIGLIANI	-9,7781%	--
SHARPE	-0,2478	--
SORTINO	-0,2529	--
TREYNOR	-0,0085	--
RISCO		
CURTOSE TRACKING-ERROR	10,2337	--
DOWNSIDE RISK	0,2580%	--
RISCO ATIVO	0,2391%	--
RISCO ATIVO ANUALIZADO	3,7962%	--
RISCO DIVERSIFICÁVEL	0,2425%	--
RISCO TOTAL	0,2633%	--
RISCO TOTAL ANUALIZADO	4,1810%	--

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	-0,3254%(01/2023)
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	-0,33%	-0,33%	6,95%	7,81%	13,26%	0,23% (11/01/2023)	-1,00% (12/01/2023)
BENCH. RECKITT (TOTAL)	1,39%	1,39%	10,64%	16,63%	23,52%	0,17% (17/01/2023)	-0,15% (02/01/2023)
CDI	1,12%	1,12%	12,83%	18,50%	21,50%	0,05% (24/01/2023)	0,05% (18/01/2023)
IBOVESPA	3,37%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%	2,19% (05/01/2023)	-3,06% (02/01/2023)
IBX	3,51%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	2,12% (05/01/2023)	-2,88% (02/01/2023)
IVBX-2	3,27%	3,27%	-12,83%	-19,13%	-25,42%	2,09% (05/01/2023)	-3,42% (02/01/2023)
SMLL	2,92%	2,92%	-15,47%	-24,13%	-27,55%	3,06% (10/01/2023)	-3,48% (02/01/2023)
IDIV	5,89%	5,89%	10,99%	17,61%	12,30%	2,12% (17/01/2023)	-2,39% (02/01/2023)
IRF-M	0,84%	0,84%	9,82%	8,42%	13,75%	0,39% (05/01/2023)	-0,36% (16/01/2023)
IMA B 5	1,40%	1,40%	11,19%	16,27%	25,06%	0,35% (10/01/2023)	-0,29% (02/01/2023)
IMA B 5+	-1,26%	-1,26%	3,66%	-3,05%	0,52%	1,10% (11/01/2023)	-1,18% (20/01/2023)
DÓLAR PTAX	-2,27%	-2,27%	-4,82%	-6,88%	19,44%	2,43% (19/01/2023)	-2,17% (06/01/2023)